

**ANALISIS *MONDAY EFFECT*, *WEEKEND EFFECT*, DAN
PENGARUH HARI PERDAGANGAN TERHADAP *RETURN* SAHAM
KELOMPOK SAHAM INDEKS LQ-45
(PERIODE FEBRUARI 2018 – JULI 2018 DAN AGUSTUS 2018 – JANUARI 2019)**

**VANDA LEIKA LENITA
NIM : 141150070**

Program Studi Ekonomi Manajemen

Fakultas Ekonomi dan Bisnis UPN “Veteran” Yogyakarta

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui dan menganalisis fenomena *Monday effect*, *Weekend effect*, dan pengaruh hari perdagangan terhadap *return* saham kelompok saham Indeks LQ-45 periode Februari 2018-Juli 2018 dan Agustus 2018-Januari 2019. Obyek pada penelitian ini adalah *return* pasar kelompok saham Indeks LQ-45. Teknik analisis data yang digunakan adalah analisis regresi berganda dengan menggunakan variabel *dummy*. Hasil pengujian menunjukkan bahwa *Weekend effect* terjadi pada kelompok saham Indeks LQ-45 periode Februari 2018-Juli 2018 dan Agustus 2018-Januari 2019, sedangkan *Monday effect* tidak terjadi. Hari perdagangan tidak berpengaruh baik secara parsial maupun simultan terhadap *return* saham kelompok saham Indeks LQ-45 selama periode Februari 2018-Juli 2018 dan Agustus 2018-Januari 2019.

Kata kunci: *Monday effect*, *Weekend effect*, hari perdagangan, *return*.