

**PENGARUH HARI LIBUR IDUL FITRI TERHADAP *ABNORMAL RETURN* PADA  
SUBSEKTOR TRANSPORTASI YANG TERDAFTAR  
DI BURSA EFEK INDONESIA PERIODE 2020**

GIAN DEWANTI

NIM : 141160002

[gyandewanti@gmail.com](mailto:gyandewanti@gmail.com)

Mahasiswa Progam Studi Manajemen  
Fakultas Ekonomi dan Bisnis  
Universitas Pembangunan Nasional “Veteran” Yogyakarta

**ABSTRAKSI**

Penelitian bertujuan untuk mengetahui dan menganalisis pengaruh hari libur Idul Fitri terhadap *abnormal return* saham perusahaan pada subsektor transportasi di Bursa Efek Indonesia periode 2020. Hari libur Idul Fitri digunakan karena memiliki periode libur yang lebih panjang dibandingkan dengan hari libur lainnya dan mayoritas masyarakat Indonesia menganut agama islam. Sampel yang digunakan dalam penelitian ini adalah saham-saham yang termasuk dalam subsektor transportasi periode 2020. Metode yang digunakan dalam penelitian ini adalah analisis *mean difference test*, yaitu *one sample t-test* dan *paired sample t-test*. Hasil dari penelitian ini adalah bahwa hari raya Idul Fitri berpengaruh terhadap *abnormal return*.

Kata kunci : anomali pasar, *holiday effect*, *abnormal return*, *efficient market hypothesis*