

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menguji dan menganalisis mengenai anomali pasar yang terjadi di Bursa Efek Indonesia terhadap peristiwa *The Day of The Week Effect*, *January Effect*, dan *Rogalsky Effect*. Alasan untuk melakukan penelitian ini adalah untuk menemukan bukti empiris terhadap peristiwa *The Day of The Week Effect*, *January Effect*, dan *Rogalsky Effect* yang ada di Bursa Efek Indonesia. Tujuan sampel yang digunakan untuk pengujian adalah perusahaan pertambangan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2017 – 2020 dengan populasi sebanyak 47 dan didapatkan sampel sebanyak 34 perusahaan dengan menggunakan metode *purposive sampling*. Setelah melakukan pengujian terhadap sampel yang digunakan, menggunakan uji normalitas bahwa pengujian akan dilakukan dengan menggunakan statistik nonparametrik untuk pengujian.

Hasil penelitian yang telah dilakukan menunjukkan secara empiris dengan menggunakan uji *Kruskal-Wallis* dan *Mann Whitney U-test* bahwa tidak terjadinya peristiwa *The Day of The Week Effect*, *January Effect*, dan *Rogalsky Effect* pada perusahaan sektor pertambangan yang ada di Bursa Efek Indonesia.

Kata kunci: *January Effect*, *Rogalsky Effect*, *The Day of The Week Effect*