

**“ANALISIS PENGARUH HARI PERDAGANGAN TERHADAP *RETURN*
SAHAM HARIAN PADA PERUSAHAAN YANG TERDAFTAR DI LQ 45
DI BURSA EFEK INDONESIA
PERIODE JANUARI 2010 SAMPAI DENGAN
DESEMBER 2010”**

ABSTRAK

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk menguji pengaruh hari perdagangan terhadap return saham harian (*Day of Week Effect* dan *Week Four Effect*) di Bursa Efek Indonesia. Sample dipilih dengan menggunakan *Purposive Sampling*, sample terdiri dari 39 saham yang termasuk dalam LQ45 selama Januari – Desember 2010. Metode yang digunakan untuk menguji hipotesis ini menggunakan *Analysis of Variance* (ANOVA) dan *One Sample t-test*. Hasil penelitian menunjukkan bahwa terjadi *Day of Week Effect* serta fenomena *Week Four Effect*.

Key words: Return Saham