

## ABSTRAK

### **PENGARUH HARI PERDAGANGAN TERHADAP RETURN SAHAM** (Studi Empiris pada Perusahaan Tercatat yang Masuk Dalam Penghitungan Indeks LQ45 Tahun 2007)

**Theresia Septi Wulandari**  
**NIM: 052114042**  
**Universitas Sanata Dharma**  
**Yogyakarta**  
**2009**

Tujuan penelitian ini adalah untuk mengetahui pengaruh hari perdagangan terhadap return saham dan *Monday effect* di Bursa Efek Indonesia. Latar belakang penelitian ini adalah pentingnya memperhatikan hari perdagangan dalam melakukan transaksi di Bursa Efek Indonesia. Hal ini disebabkan karena terdapat perbedaan return untuk masing-masing hari perdagangan dalam satu minggu.

Jenis penelitian ini adalah studi empiris. Pengambilan sampel dengan metode *purposive sampling*, adapun perusahaan yang memenuhi kriteria untuk menjadi sampel adalah 37 perusahaan tercatat yang masuk dalam penghitungan indeks LQ45 tahun 2007, dan hari perdagangan yang digunakan sebanyak 220 hari. Data diperoleh melalui database Bursa Efek Indonesia yang tersedia secara online. Teknik analisis data yang digunakan adalah uji beda rata-rata dengan menggunakan *One Way ANOVA* dan *Multiple Comparisons*.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa hari perdagangan berpengaruh terhadap return saham. Sedangkan *Monday effect* terjadi di Bursa Efek Indonesia, terbukti dengan adanya perbedaan rata-rata return yang signifikan antara hari Senin dengan hari Rabu.

## **ABSTRAC**

### **THE EFFECT OF TRADING DAYS ON STOCK RETURN** (An Empirical Study on Registered Companies Including in LQ45 Index Calculation for the year 2007)

**Theresia Septi Wulandari**  
**NIM: 052114042**  
**Sanata Dharma University**  
**Yogyakarta**  
**2009**

The purpose of this research was to find out the effect of trading days on stock return and Monday effect in Indonesia Stock Exchange. The background of this research is the importance of paying attention of trading day in doing transaction in Indonesia Stock Exchange. It is caused by the differences of the return in each of trading day in a week.

This research was an empirical study. The sampling was taken using purposive sampling method. There were 37 companies which fulfilled the criteria to be the sample and they were included in LQ45 index calculation in 2007, and trading days used were 220 days. The data were taken from Indonesia Stock Exchange database and that were available online. The data analysis technique were mean difference test by using One Way ANOVA and Multiple Comparisons

The result of this research showed that simultaneously trading day influenced the stock return. In the other hand Monday effect was happened in Indonesia Stock Return, it was proven by the significant of the differences of the average return between Monday and Wednesday.