

**ANALISIS PENGARUH DAY OF THE WEEK EFFECT TERHADAP
RETURN SAHAM PADA BURSA EFEK JAKARTA PERIODE JANUARI
2014 SAMPAI DENGAN DESEMBER 2014**

MUHAMMAD YUSUF

*Program Studi Akuntansi - S1, Fakultas Ekonomi & Bisnis,
Universitas Dian Nuswantoro Semarang
URL : <http://dinus.ac.id/>
Email : 212201202244@mhs.dinus.ac.id*

ABSTRAK

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk menguji pengaruh hari perdagangan terhadap return saham di Bursa Efek Jakarta. Terdiri dari 241 hari perdagangan yang masuk dalam LQ45 selama periode Januari - Desember 2014. Metode Statistik yang digunakan untuk menguji hipotesis meliputi Analysis of Variance (ANOVA), One Way ANOVA dengan melihat nilai signifikansi pada tabel Test of Between-Subjects Effects dan Multiple Comparisons pada Turkey HSD Test. Hasil penelitian menunjukkan bahwa hari perdagangan saham tidak berpengaruh terhadap return saham dan tidak terdapat perbedaan return saham LQ45 pada setiap hari perdagangan.

Kata Kunci : hari perdagangan saham, return saham BEJ, return saham LQ45

**ANALYSIS OF DAY OF THE WEEK EFFECT ON THE STOCK
RETURNS IN JAKARTA STOCK EXCHANGE DURING JANUARY TO
DECEMBER 2014**

MUHAMMAD YUSUF

*Program Studi Akuntansi - S1, Fakultas Ekonomi & Bisnis,
Universitas Dian Nuswantoro Semarang
URL : <http://dinus.ac.id/>
Email : 212201202244@mhs.dinus.ac.id*

ABSTRACT

This research aims to examine day of the week effect on the stock returns in Jakarta Stock Exchange. Consists of 241 days of the week are included in the LQ45 index during January to December 2014. The Statistic methods are used to test hypotheses are Analysis of Variance (ANOVA) and One Way ANOVA by looking at the value of significance table in the Test of Between-Subjects Effects and Multiple Comparisons on Turkey HSD Test. The results show that the day of the week has no effect on the stock returns and there is no difference of LQ45 stock returns on each day of the week.

Keyword : day of the week effect, JSX stock returns, LQ45 stock returns