ABSTRAK

Aaron Wijaya / 24150512 / 2019 / Analisis *Monday Effect* Terhadap *Return* Saham, Volume Perdagangan Dan Peluang *Return* Negatif Dan Peluang *Return* Positif Perusahaan Pada Sektor LQ 45 di Bursa Efek Indonesia Periode 2017/ Pembimbing : Dr. Said Kelana Asnawi, M.M.

Para investor memiliki kecenderungan untuk kurang menyukai hari Senin sebagai minggu awal kerja sehingga mempengaruhi mood investor dalam melakukan aktivitas perdagangan saham.Hal ini yang menyebabkan investor mengalami kerugian pada hari Senin,

Fenomena *Monday Efect* menyatakan bahwa *return* pada hari Senin cenderung menghasilkan *return* yang negatif, sedangkan *return* positif terjadi pada hari-hari selain Senin. *Monday effect* terjadi karena dipengaruhi oleh pola perilaku investor yang tidak rasional dalam melakukan perdagangan hari Senin.

Penelitian ini akan menggunakan data perusahaan yang terdaftar dalam indeks LQ 45 di Bursa Efek Indonesia pada tahun 2017.Indeks LQ45 adalah salah satu indeks saham yang ada pada Bursa Efek Indonesia yang menghitung indeks rata-rata 45 saham yang memenuhi kriteria berkapitalisasi pasar terbesar dan mempunyai tingkat likuiditas nilai perdagangan yang tinggi.

Hasil dari penelitian adalah kemungkinan untuk mendapatkan *return* negatif pada masing-masing hari terbilang cukup kecil yaitu di bawah 30%, berarti kemungkinan mendapatkan keuntungan lebih besar dari pada kerugian.Dapat disimpulkan dalam sektor LQ 45 memiliki peluang yang besar untuk memperoleh keuntungan .

Terdapat pengaruh return terendah pada hari Senin (Monday Effect), melainkan rerata return terendah pada hari Selasa (Tuesday Effect) seperti pada penelitian ini di indeks LQ 45 Bursa Efek Indonesia. Terdapat juga peluang return positif yang lebih besar dibandingkan dengan peluang return negatif pada sektor LQ 45

Kata Kunci : Monday Effect,LQ 45