**ABSTRAK**

Giovanni Salim / 25150005 / 2019 / Analisis *Monday Effect* Terhadap *Return* Saham, Volume Perdagangan Dan Peluang *Return* Negatif Dan Peluang *Return* Positif Perusahaan Pada Sektor Aneka Industri Dan Sektor Industri Barang Konsumsi di Bursa Efek Indonesia Periode 2017/ Pembimbing : Dr. Said Kelana Asnawi

Hari perdagangan saham terdiri dari lima hari dalam satu minggu yaitu senin, selasa, rabu, kamis, dan jumat. Hal ini sesuai dengan penerapan hari kerja secara umum, dimana untuk hari sabtu dan minggu adalah hari libur dan pada hari tersebut perdagangan saham tutup, karena adanya hari libur tersebut menyebabkan adanya 2 hari kosong dari jumat ke senin yang menyebabkan banyak informasi yang diserap oleh investor yang dapat mempengaruhi faktor psikologis dari investor.

Pada *Monday Effect* terdapat perbedaan *return* pada hari senin dengan hari selain senin. Dimana pada hari senin *return* akan negatif dan lebih kecil dibandingkan dengan *return* hari selain senin. Demikian pula *return* hari jumat akan positif dan lebih besar dibandingkan dengan *return* hari selain jumat.

Penelitian ini menggunakan perusahaan yang terdapat pada sektor aneka industri dan sektor industri barang konsumsi di Bursa Efek Indonesia (BEI) pada periode Januari 2017 – Desember 2017. Penelitian ini menggunakan *return open-close* , *return close-close* dan juga volume perdagangan untuk mencari tahu apakah terdapat *Monday Effect* dan juga berapa besar peluang untuk mendapatkan *return* positif maupun *return* negatif

Hasil dari penelitian adalah terdapat perbedaan signifikan pada return hari senin dengan return hari selasa di *return open-close* sedangkan tidak terdapat perbedaan yang signifikan pada *return* close-close dan volume perdagangan. Peluang untuk mendapatkan *return positif* lebih besar daripada *return negatif* dimana semua peluang untuk mendapatkan *return* positif diatas 60%.

Tidak terdapat perbedaan yang signifikan dalam penelitian ini untuk mengatakan bahwa adanya anomali *Monday Effect*. Sehingga tidak ada perbedaan di *return* hari senin dengan *return* hari selain senin. Dengan peluang untuk mendapatkan *return* positif yang diatas 60% maka disarankan untuk para investor berinvestasi di sektor ini karena memiliki presentase untuk mendapatkan keuntungan yang lebih besar daripada kerugian.