# ABSTRAK

Andreas Kristianto / 26150280 / 2019 /Analisis *Monday Effect* terhadap *Return* Saham. Volume Perdagangan, dan Probabilitas *Return* Negatif & Positif pada Sektor Pertanian, Pertambangan, dan Industri Dasar & Kimia di Bursa Efek Indonesia (BEI) Periode Januari 2017-Desember 2017 / Dr. Said Kelana Asnawi

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis apakah ada fenomena Monday Effect pada perusahaan yang berada di sektor pertanian, pertambangan, dan industri dasar dan kimia yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia pada periode tahun 2017. Kinerja keuangan yang digunakan dalam penelitian ini antara lain: *Return*, *Shares*.

Fenomena *Monday Effect* dikatakan bahwa return hari senin lebih kecil dibandingkan hari perdagangan lainnya dikarenakan ada faktor dari perbedaan informasi baru yang masuk karena untuk hari senin memiliki (3) hari untuk informasi baru sedangkan hari lainnya hanya memiliki (1) hari untuk informasi baru.

Metode pengumpulan data yang digunakan adalah metode observasi. Teknik pengambilan data yang digunakan adalah *non probability sampling* dimana penulis mengambil data dari (3) sektor yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) yang melakukan aktivitas jual beli saham pada periode tahun 2017. Data akan diuji dengan menggunakan *Paired Sample t-Test* untuk menguji fenomena *Monday Effect* dan Uji Analisis Regresi Logistik untuk melihat probabilitas *return* positif dan negatif.

Hasil pengujian menunjukkan bahwa hari senin terbukti memiliki return yang lebih kecil dibanding hari lainnya dan memiliki hasil yang signifikan untuk *return open close dan close close*, sedangkan untuk *shares* tidak terdapat hasil yang signifikan. Berdasarkan uji hasil tersebut dapat dilihat bahwa estimasi kemungkinan return positif lebih besar dibanding return negatif di angka 60% untuk *return open close* dan 53% untuk *return close close.*

Hasil penelitian ini menyimpulkan bahwa terdapat hasil yang signifikan dan fenomena *Monday Effect* benar terjadi pada sektor pertanian, pertambangan, dan industri dasar dan kimia yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia pada periode tahun 2017.

Kata kunci: *Monday Effect*, *shares*, *return,negative return probability*