

ABSTRAK

Pramudia Yuly Eka Permana, "Pengaruh Anomali Pasar Hari Perdagangan Terhadap Return Saham Perusahaan di Jakarta Islamic Index". Dibawah bimbingan Dr. Chairul Anam, Drs. Ec., M.Kes dan R. Gatot Heru Prajoto, S.E., MM.

Tujuan dilakukan penelitian ini adalah untuk mengetahui pengaruh hari perdagangan terhadap *return* harian pada perusahaan yang terdaftar pada *Jakarta Islamic index* (JII).

Pendekatan penelitian yang digunakan dalam penelitian ini adalah kuantitatif. Sampel dalam penelitian ini adalah saham-saham perusahaan yang terdaftar di *Jakarta Islamic Index* (JII) yang berjumlah 28 perusahaan. Metode pengambilan sampel yang digunakan adalah *purposive sampling*. Teknik analisis data yang digunakan untuk menguji hipotesis adalah menggunakan analisis deskriptif dan regresi linier berganda dengan memakai uji F (simultan) dan uji t (parsial).

Berdasarkan hasil penelitian menunjukkan bahwa nilai *adjusted R Square* sebesar 0,0151 yang berarti besarnya pengaruh variabel bebas terhadap variabel terikat adalah 1,51%, sedangkan sisanya 98,49% dipengaruhi oleh variabel lain yang tidak diteliti dalam penelitian ini. Berdasarkan uji F hari perdagangan yang terdiri dari hari senin, Selasa, Rabu, Kamis dan Jum'at secara simultan tidak berpengaruh signifikan terhadap return perusahaan di JII. Berdasarkan uji t diketahui bahwa hari perdagangan yang terdiri dari hari senin, Selasa, Rabu, Kamis dan Jum'at tidak berpengaruh signifikan terhadap return perusahaan di JII.

Kata kunci : Hari perdagangan, return perusahaan

ABSTRACT

Pramudia Yuly Eka Permana, "The Influence of Market Anomalies Trading Day on Company Return in Jakarta Islamic Index". Under the guidance of Dr. Chairul Anam, Drs. Ec., Kes, and R. Gatot Heru Prajoto, S.E., MM.

Purpose of this research was to determine the effect of the trading day on the companies daily return in Jakarta Islamic Index (JII).

The Research approach used is quantitative, the sample in this study are shares of companies listed on the Jakarta Islamic Index (JII) totaling 28 companies. Samples collecting method applied is purposive sampling. Data analysis technique applied for hypothesis testing is descriptive and multiple linear regressions analysis by involving F tes (simultaneous) and t test (partial)

The results of study show that the *adjusted R Square* value is 0,0151. It means the amount influence of independent to dependent variable is 1,51%, while the remaining of 98,49% is influenced by other variables not examined in this study. Based on the F test which consists of the trading day on Monday, Tuesday, Wednesday, Thursday and Friday simultaneously no significant effect on returns in JII. Based on the t test is known that trading day consists of Monday, Tuesday, Wednesday, Thursday and Friday no significant effect on returns in JII.

Keywords: day trading, the company returns