


**ANALISIS *DAY OF THE WEEK EFFECT* TERHADAP *RETURN INDEKS*  
HARGA SAHAM PADA NEGARA ASEAN-5 SEBELUM DAN SAAT  
PANDEMI COVID-19**

**SKRIPSI**

Diajukan sebagai Salah Satu Syarat untuk Mencapai Gelar Sarjana Pada Program  
Studi S1 Jurusan Manajemen Fakultas Ekonomi Universitas Andalas



**PROGRAM STUDI S1 JURUSAN MANAJEMEN  
FAKULTAS EKONOMI  
UNIVERSITAS ANDALAS  
PADANG  
2022**

	No. Alumni Universitas	<b>Eldinda Rahmi</b>	No. Alumni Fakultas
	a) Tempat/Tgl Lahir : Padang/26 November 2000, b) Nama Orang Tua : Alm. Darisman Edi dan Almh. Elianur, c) Fakultas : Ekonomi, d) Jurusan : Manajemen, e) No. BP : 1810522006, f) Tanggal Lulus : 20 April 2022, g) Prediket Lulus : Dengan Pujian, h) IPK : 3.80, i) Lama Studi : 3 Tahun 8 Bulan, j) Alamat Orang Tua : -		

**ANALISIS DAY OF THE WEEK EFFECT TERHADAP RETURN INDEKS HARGA SAHAM PADA NEGARA ASEAN-5 SEBELUM DAN SAAT PANDEMI COVID-19**

*Skripsi oleh Eldinda Rahmi*

*Pembimbing : Mohamad Fany Alfarisi, SE, MS Fin, PhD*

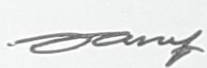
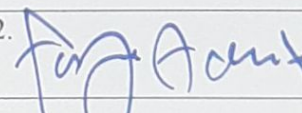
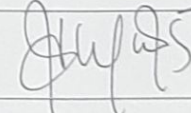
**ABSTRAK**

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis fenomena *day of the week effect* terhadap *return* indeks harga saham pada negara ASEAN-5 sebelum dan saat terjadi pandemi Covid-19. Sampel penelitian ini merupakan *closing price* pada indeks negara ASEAN-5, terhitung selama satu bulan sebelum Covid-19 (T-20) dan satu bulan saat terjadi Covid-19 (T+20). Pengumpulan data menggunakan metode dokumentasi dan diolah menggunakan *software* IBM SPSS Statistics 23 dan dibantu *Microsoft Excel*. Teknik analisis data menggunakan analisis statistik deskriptif, uji normalitas, uji anova, dan uji *paired t-test*. Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwa *day of the week effect* terjadi di Thailand sehingga adanya perbedaan *return* saham selama lima hari perdagangan, sedangkan Indonesia, Singapura, Malaysia, dan Filipina terbukti tidak terjadi fenomena *day of the week effect*. Didapatkan juga hasil bahwa tidak terdapat perbedaan *return* indeks harga saham sebelum dan saat pandemi Covid-19 pada negara Indonesia, Singapura, Malaysia, Thailand, dan Filipina.

**Kata Kunci : *day of the week effect, return, ASEAN-5***

Skripsi telah dipertahankan di depan sidang penguji dan dinyatakan lulus pada tanggal : 20 April 2022

Abstrak telah di setujui oleh :

Tanda Tangan	1. 	2. 	3. 
Nama Terang	Mohamad Fany Alfarisi, SE, MS Fin, PhD	Fajri Adrianto SE M.Bus (Adv) PhD	Desyetti, SE, ME

Mengetahui,  
Ketua Jurusan Manajemen

Hendra Lukito, SE, MM, Ph.D  
NIP.197106242006041007

Alumnus telah mendaftar ke Fakultas/Universitas dan Mendapat Nomor Alumnus :



	Petugas Fakultas/ Universitas	
No. Alumni Fakultas	Nama :	Tanda Tangan :
No. Alumni Universitas	Nama :	Tanda Tangan :