

**PENGARUH HARI PERDAGANGAN *MONDAY EFFECT* DAN
WEEKEND EFFECT TERHADAP RETURN SAHAM
JAKARTA ISLAMIC INDEKS (JII)**

SKRIPSI

Diajukan sebagai Salah Satu Syarat untuk Mencapai Gelas Sarjana Pada Program
Studi S1 Departemen Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas
Andalas



Diajukan Oleh:

RAISYA WAHIDA TILLAH

2010522003

**PROGRAM STUDI S1 DEPARTEMEN MANAJEMEN
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS
UNIVERSITAS ANDALAS**

PADANG

2024



No. Alumni Univeristas	Raisya Wahida Tillah	No. Alumni Fakultas
a) Tempat/Tgl Lahir: Tiku/25 Februari 2002 b) Nama Orang Tua: Irjasman dan Desi Arisanti c) Fakultas: Ekonomi dan Bisnis d) Departemen: manajemen e) No BP: 2010521005 f) Tanggal lulus 04 Juni 2024 g) Predikat Lulus: Dengan Pujian h) IPK: 3.72 i) Lama Studi: 3 Tahun 10 Bulan j) Alamat Orang Tua: Tiku V Jorong		

Pengaruh Hari Perdagangan Monday Effect Dan Weekend Effect Terhadap Return Saham Jakarta Islamic Indeks (JII)

Skripsi Oleh: Raisya Wahida Tillah

Pembimbing: Prof. Dr. Tafdil Husni, SE, MBA

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan menganalisis pengaruh hari perdagangan *Monday effect* dan *Weekend effect* terhadap *Return* saham di *Jakarta Islamic Index (JII)*. Sampel penelitian ini ialah *return* saham harian *Jakarta Islamic Index (JII)* dari tahun 2018 hingga 2023 yang dianalisis menggunakan STATA 17. Hasil penelitian yang menunjukkan bahwa hanya pada hari Selasa yang terdapat pengaruh signifikan terhadap return indeks JII. Sementara itu, pada hari-hari perdagangan lainnya, tidak terdapat dampak yang signifikan terhadap return indeks. Temuan ini memberikan pandangan bagi investor untuk lebih berhati-hati dalam mengambil keputusan berinvestasi serta memperhatikan waktu yang tepat dalam melakukan transaksi di Bursa Efek Indonesia, terutama di *Jakarta Islamic Index (JII)*.

Kata Kunci: *Return* saham, Hari perdagangan, *Monday effect*, *Weekend effect*

Skripsi telah dipertahankan di depan sidang penguji dan dinyatakan lulus pada: 04 Juni 2024

Abstrak telah disetujui oleh:

Tanda Tangan			
Nama Terang	Prof. Dr. Tafdil Husni, SE, MBA	Masyuri Hamidi, SE, M. Si, CFP, Ph.D	Fajri Adrianto, SE, M.Bus (Adv) Ph.D

Mengetahui,
Ketua Departemen Manajemen

Hendra Lukito, SE, MM, Ph.D

NIP. 197106242006041007

Tanda Tangan

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

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