

ABSTRAK

Penelitian ini membahas mengenai pengaruh hari perdagangan terhadap *return* saham perusahaan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Penelitian ini dilakukan dengan tujuan untuk menguji dan menganalisis terjadinya *the day of the week effect* dan *week four effect* pada *return* saham di Bursa Efek Indonesia.

Populasi dalam penelitian ini adalah perusahaan terbuka yang ada di Bursa Efek Indonesia. Sampel dipilih dengan menggunakan *purposive sampling*. Sampel dalam penelitian ini adalah perusahaan-perusahaan yang terdaftar dalam Sektor Industri Barang Konsumsi selama tahun 2010. Dari 34 perusahaan hanya terdapat 23 perusahaan yang terdaftar dalam Sektor Industri Barang Konsumsi secara terus menerus selama Januari-Desember 2010.

Pengujian hipotesis dilakukan dengan ANOVA dan *one sample t_{test}*. Hasil uji hipotesis 1 dengan menggunakan ANOVA menunjukkan bahwa tidak terjadi *the day of the week effect* tahun 2010. Hasil uji hipotesis 2 dengan menggunakan *one sample t_{test}* menunjukkan terjadi-nya *week four effect* tahun 2010.

Dari hasil yang didapat, maka disarankan bagi para investor agar mempertimbangkan kondisi internal dan eksternal yang terjadi di Bursa Efek Indonesia untuk dapat memperoleh *return* saham yang maksimal dan Investor juga disarankan untuk melakukan pembelian saham pada hari Senin diminggu keempat dan minggu kelima setiap bulannya. Sedangkan untuk Bursa Efek Indonesia juga harus mampu mengeluarkan kebijakan-kebijakan yang dapat membantu para investor agar investor tetap berminat untuk berinvestasi melalui saham yang diperdagangkan.

Kata kunci : *Return Saham, The Day of The Week Effect, Week Four Effect.*