

**ANALISIS ANOMALI PASAR : *MONDAY EFFECT* PADA
PERUSAHAAN YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK
INDONESIA SEKTOR PERTAMBANGAN (PERIODE
AGUSTUS 2020 – JANUARI 2021)**



OLEH:

NAMA : DWI NUR HANDAYANI

NIM : 041701503125108

**FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS
UNIVERSITAS SATYA NEGARA INDONESIA**

2021

**ANALISIS ANOMALI PASAR : *MONDAY EFFECT* PADA
PERUSAHAAN YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK
INDONESIA SEKTOR PERTAMBANGAN (PERIODE
AGUSTUS 2020 – JANUARI 2021)**

SKRIPSI

Diajukan Sebagai Salah Satu Syarat Untuk Memperoleh Gelar

**SARJANA MANAJEMEN
Program Studi Manajemen – Strata 1**



OLEH:

NAMA : DWI NUR HANDAYANI

NIM : 041701503125108

**FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS
UNIVERSITAS SATYA NEGARA INDONESIA**

2021

***MARKET ANOMALY ANALYSIS : MONDAY EFFECT ON
COMPANIES LISTED ON THE INDONESIA STOCK
EXCHANGE MINING SECTOR (PERIOD OF AUGUST 2020 –
JANUARY 2021)***

THESIS

The Study Program : Management



NAME : DWI NUR HANDAYANI

NIM : 041701503125108

***FACULTY OF ECONOMICS AND BUSINESS
SATYA NEGARA INDONESIA UNIVERSITY***

2021

***MARKET ANOMALY ANALYSIS : MONDAY EFFECT ON
COMPANIES LISTED ON THE INDONESIA STOCK
EXCHANGE MINING SECTOR (PERIOD OF AUGUST 2020 –
JANUARY 2021)***

THESIS

Submitted as one of the requirements for obtaining a degree

BACHELOR IN MANAGEMENT

Management Study Program – Undergraduate 1



BY:

NAME : DWI NUR HANDAYANI

NIM : 041701503125108

FACULTY OF ECONOMICS AND BUSINESS

SATYA NEGARA INDONESIA UNIVERSITY

2021

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menguji dan menganalisis apakah terdapat fenomena *Monday Effect* pada perusahaan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia sektor pertambangan periode Agustus 2020 – Januari 2021. Pemilihan sampel penelitian menggunakan metode *purposive sampling*. Analisis data dilakukan dengan analisis deskriptif, uji normalitas dan pengujian hipotesis statistik non parametrik dengan *Wilcoxon Signed Rank Test* menggunakan software SPSS ver.22. Hasil penelitian menunjukkan bahwa tidak terdapat perbedaan *return* saham hari Senin dengan *return* saham selain hari Senin, dimana rata-rata *return* terendah tidak terjadi pada hari Senin melainkan terjadi pada hari Kamis. Penelitian ini sekaligus menjelaskan bahwa tidak ditemukan fenomena *Monday Effect* pada perusahaan pertambangan di Bursa Efek Indonesia.

Kata Kunci : *Anomali Pasar, Monday Effect, Return Saham Aktual*



ABSTRACT

This study aims to test and analyze whether there is a Monday Effect phenomenon in companies listed on the Indonesia Stock Exchange in the mining sector for the period August 2020 - January 2021. The selection of research samples uses purposive sampling method. Data analysis was carried out by descriptive analysis, normality test and non-parametric statistical hypothesis testing with Wilcoxon Signed Rank Test using SPSS ver.22 software. The results show that there is no difference in stock returns on Mondays with stock returns other than Mondays, where the lowest average return does not occur on Monday but occurs on Thursday. This study also explains that there is no Monday Effect phenomenon found in mining companies on the Indonesia Stock Exchange.

Keywords: *Market Anomaly, Monday Effect, Actual Stock Return*

