

## ABSTRAK

*Return* saham merupakan hasil dari investasi atau tingkat keuntungan yang dinikmati oleh pemodal atau investasi yang dilakukan, return dihitung dari return sesungguhnya return ekspektasi *yield*. Penelitian ini dimaksudkan untuk mengetahui pengaruh *Monday Effect*, *Weekend Effect* dan *Week Four Effect* terhadap *Return* Saham pada perusahaan LQ45 yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia.

Kondisi *Monday Effect*, *Weekend Effect* dan *Week Four Effect* dievaluasi dengan melihat data sekunder yang diukur dengan rumus *Return* yang dimaksudkan untuk mengetahui kondisi *Monday Effect*, *Weekend Effect* dan *Week Four Effect* terhadap *Return* saham. Berdasarkan kelengkapan data ada 40 perusahaan yang termasuk kedalam sampel penelitian pada periode Februari 2018 sampai dengan Januari 2019 yang dapat dianalisis. Analisis data yang digunakan adalah regresi data panel dengan alat bantu *EVIIEWS 10* dan *Microsoft Excel*.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa *Monday Effect*, *Weekend Effect* dan *Week Four Effect* terhadap *Return* saham memberikan pengaruh kontribusi sebesar 70,90%, sedangkan sisanya 29,01% dipengaruhi variabel lain yang tidak diteliti. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa *Monday Effect* berpengaruh signifikan terhadap *Return* Saham *Weekend Effect* berpengaruh signifikan terhadap *Return* saham dan *Week Four Effect* berpengaruh signifikan terhadap *Return* saham.

Kata Kunci : *Return* saham, *Monday Effect*, *Weekend Effect*, *Week Four Effect*.