

INTI SARI

Penelitian ini bertujuan untuk menguji pengaruh Hari Perdagangan Saham (Senin, Selasa, Rabu, Kamis, Jum'at) terhadap *return* saham harian di Bursa Efek Jakarta (BEJ). Analisis dilakukan dengan menghitung *return* saham harian selama periode bulan Februari sampai dengan Juli 2004. Hasil pengujian secara parsial menunjukkan adanya pengaruh yang positif dan signifikan hari perdagangan Selasa, Rabu, Kamis, Jum'at terhadap *return* saham harian. Artinya dari hari perdagangan Selasa sampai hari perdagangan Jum'at, *investor* memperoleh *capital gains*. Dan hasil pengujian secara simultan menunjukkan bahwa hari perdagangan saham berpengaruh signifikan terhadap *return* saham harian di Bursa Efek Jakarta, sehingga berhasil mendukung hipotesis yang diajukan.