

INTISARI

Penelitian ini berjudul “Analisis Pengaruh Hari Perdagangan Saham Terhadap Indeks LQ45 penelitian ini bertujuan untuk mengidentifikasi : Pengaruh Hari Perdagangan Saham terhadap Indeks LQ45 Di Bursa Efek Jakarta, Pengaruh Hari Perdagangan Saham terhadap *return* Indeks LQ45 Di Bursa Efek Jakarta, ada tidaknya pengaruh *return market* Indeks LQ45 hari sebelumnya terhadap *return market* Indeks LQ45 hari sekarang Di Bursa Efek Jakarta.

Yang menjadi obyek penelitian ini adalah Perusahaan yang terdaftar di Bursa Efek Jakarta yang listing tahun 2005. Penelitian ini menggunakan *Purposive sampling* artinya tehnik pengambilan sampel atas dasar adanya beberapa pertimbangan tertentu. Alat analisis data yang digunakan yaitu Regresi Linear Berganda dengan menggunakan variabel *dummy*.

Dari hasil penelitian yang dihitung dengan menggunakan alat analisis Regresi Linear Berganda, pada hipotesis pertama dari hasil Uji F dan Uji T menyatakan bahwa ada pengaruh positif yang signifikan antara Hari Perdagangan Saham terhadap Indeks LQ45, pada hipotesis yang kedua dari hasil Uji F menyatakan bahwa ada pengaruh positif yang signifikan antara Hari Perdagangan Saham terhadap *return* Indeks LQ45 sedangkan pada Uji T hanya hari Senin yang menyatakan bahwa ada pengaruh positif yang signifikan antara Hari Perdagangan Saham terhadap *return* Indeks LQ45. Dan pada hipotesis yang ketiga menunjukkan bahwa ada pengaruh signifikan *return market* Indeks LQ45 sebelumnya terhadap *return market* Indeks LQ45 sekarang.

ABSTRACT

This research entitle the "Analysis of day of share Commerce of To this Index LQ45" research aim to identify the: Influence of Day of Share Commerce to Index LQ45 In Effect Exchange Jakarta, Influence of day of share Commerce to return Make an Index To LQ45 In Effect Exchange Jakarta, there is not it him influence of return market Make an Index to the previous LQ45 day to return market Make an index to the LQ45 day now In Effect Exchange Jakarta.

Becoming this obyek research is Company enlisted in Effect Exchange of Jakarta which listing year 2005. this research use the its Purposive meaning sampling is technics of intake sampel on the basis of cxistence of some certain consideration. Data analyzer used by that is Doubled Linear Regression by using variable dummy.

From research result counted by using Doubled Linear Regression analyzer, at first hypothesis from result Test the F and Test the T express that there is positive influence is which signifikan of among day of share Commerce to Index LQ45, at second hypotesis from result Test the F express that this positive influence is which signifikan of among Day of Share Commerce to return Make an Index to the LQ45 of while at the test T of only Monday expressing that there is positive influence is which signifikan of among day of Share Commerce to return Make an Index to the LQ45. And at third hyphotesis indicate that there is influence of signifikan return market Make an Index to the previous LQ45 to return market Make an Index to the LQ45 now.

Keyword: Day of Share Commerce and Return Market