

## BAB V

### KESIMPULAN DAN SARAN

#### 5.1. Kesimpulan

Tujuan penelitian ini yaitu membuktikan terdapatnya efek hari Senin dan hari Jumat pada saham pembentuk Indeks LQ45. Berdasarkan hasil pengujian hipotesis yang telah dilakukan, ternyata ditemukan efek hari Senin dan tidak ditemukan efek hari Jumat pada saham pembentuk Indeks LQ45 dalam kurun waktu Januari 2006 sampai Desember 2016.

#### 5.2. Saran

Penelitian ini memiliki keterbatasan dalam hal jumlah emiten sebagai sampel yang berukuran kecil. Peneliti selanjutnya dapat menggunakan emiten pembentuk Indeks Kompas 100 sebagai sampel penelitian. Dengan demikian, hasil penelitian lebih dapat mencerminkan kondisi anomali *return* saham berdasarkan hari perdagangan saham dengan memasukkan efek hari Senin dan efek hari Jumat.