

LAPORAN SKRIPSI

**DAMPAK HARI LIBUR NASIONAL DAN HARI LIBUR KEAGAMAAN
TERHADAP RETURN SAHAM PADA LQ-45
Di BURSA EFEK INDONESIA
PERIODE 2020 – 2022**



Di Susun Oleh

Gracia Stephanie Juniarti Sianturi

19.D1.0200

PROGRAM STUDI MANAJEMEN

FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS

UNIVERSITAS KATOLIK SOEGIJAPRANATA

SEMARANG

2023

LAPORAN SKRIPSI

**DAMPAK HARI LIBUR NASIONAL DAN HARI LIBUR KEAGAMAAN
TERHADAP RETURN SAHAM PADA LQ-45
Di BURSA EFEK INDONESIA
PERIODE 2020 – 2022**

**Diajukan Dalam Rangka Memenuhi Salah Satu Syarat Memperoleh
Program Sarjana (S1) Pada Fakultas Ekonomi dan Bisnis
Jurusan Manajemen
Universitas Katolik Soegijapranata**



Di Susun Oleh

Gracia Stephanie Juniarti Sianturi

19.D1.0200

**PROGRAM STUDI MANAJEMEN
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS
UNIVERSITAS KATOLIK SOEGIJAPRANATA
SEMARANG**

2023

ABSTRAK

Penelitian ini akan menguji dampak Hari Libur Nasional dan Hari Libur Keagamaan terhadap return saham pada LQ-45 di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2020 – 2022. Return didapat dari hasil yang diperoleh dari investasi. Populasi dalam penelitian ini berdasarkan data perusahaan pada LQ-45 yang terdaftar Di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2020 – 2022. Jenis penelitian ini adalah *event study* sehingga periode pengamatan yang digunakan untuk melihat sebelum dan sesudah peristiwa terjadi. Periode penelitian yang digunakan adalah 10 hari pengamatan yaitu 5 hari sebelum dan 5 hari sesudah peristiwa. Metode analisis yang akan digunakan yaitu analisis statistik deskriptif, Uji Normalitas, dan Uji *Paired Sample Test*. Hasil penelitian menunjukkan bahwa Hari Libur nasional dan Hari Libur Keagamaan berdampak pada return saham yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2020 – 2022.

Kata Kunci : *Return, event study, Hari Libur Nasional, Hari Libur Keagamaan.*



ABSTRAC

This study will examine the impact of National Holidays and Religious Holidays on stock returns at LQ-45 on the Indonesia Stock Exchange (IDX) for the period 2020 – 2022. Returns are obtained from the results obtained from investments. The population in this study is based on company data at LQ-45 listed on the Indonesia Stock Exchange (IDX) for the period 2020 – 2022. This type of research is an event study so that the observation period is used to see before and after the event occurred. The research period used was 10 days of observation, namely 5 days before and 5 days after the event. The analytical method that will be used is descriptive statistical analysis, Normality test, and Paired Sample Test. The results of the study show that national holidays and religious holidays have an impact on stock returns listed on the Indonesia Stock Exchange (IDX) for the period 2020 – 2022.

Keywords : *Return, event study, National Holidays, Religious Holidays.*

