

**ANALISIS FENOMENA *WEEKEND EFFECT* PADA
RETURN SAHAM DI BURSA EFEK INDONESIA
DENGAN METODE *ARMA* DAN *GARCH***

*Event Study pada Indeks LQ 45 di Bursa Efek Indonesia
Tahun 2003-2007*

Thesis
untuk memenuhi sebagian persyaratan
mencapai derajat Sarjana S-2

Program Studi Magister Manajemen
Jurusan Ilmu-ilmu Sosial



diajukan oleh
Willyam Gloria Siagian
19350/PS/MM/06

Kepada
**FAKULTAS EKONOMIKA DAN BISNIS
UNIVERSITAS GADJAH MADA**
2008