

FENOMENA ANOMALI PASAR PADA PERUSAHAAN LQ 45 DI BURSA EFEK

INDONESIA TAHUN 2017

TESIS

Disusun dan diajukan untuk memenuhi salah satu syarat untuk mencapai derajat Sarjana
Strata – 2 pada Program Pascasarjana Program Studi Magister Manajemen Universitas Islam

Indonesia



Disusun Oleh:

MIFTA FITRIYANA

16911034

PROGRAM PASCASARJANA FAKULTAS EKONOMI

PROGRAM STUDI MAGISTER MANAJEMEN

UNIVERSITAS ISLAM INDONESIA

YOGYAKARTA

2018

FENOMENA ANOMALI PASAR PADA PERUSAHAAN LQ 45 DI BURSA EFEK

INDONESIA TAHUN 2017

Tesis S- 2

Program Magister Manajemen



Diajukan Oleh:

MIFTA FITRIYANA

16911034

PROGRAM PASCASARJANA FAKULTAS EKONOMI

PROGRAM STUDI MAGISTER MANAJEMEN

UNIVERSITAS ISLAM INDONESIA

YOGYAKARTA

2018

PERNYATAAN BEBAS PLAGIARISME

Dengan ini saya menyatakan bahwa dalam tesis ini tidak terdapat karya yang pernah diajukan untuk memperoleh gelar kesarjanaan di suatu Perguruan Tinggi, dan sepanjang pengetahuan saya juga tidak terdapat karya atau pendapat yang pernah ditulis atau diterbitkan oleh orang lain, kecuali yang secara tertulis diacu dalam naskah ini dan disebutkan dalam referensi. Apabila dikemudian hari terbukti bahwa pernyataan ini tidak benar, maka saya sanggup menerima hukuman / sanksi apapun sesuai peraturan yang berlaku.

Yogyakarta, 27 September 2018



Mifta Fitriyana

HALAMAN PENGESAHAN



Yogyakarta, 28-9-2018

Telah diterima dan disetujui dengan baik oleh :

Dosen Pembimbing

A handwritten signature in black ink, appearing to be 'Sutrisno', is written over a horizontal line.

Dr. Drs. Sutrisno, MM.

BERITA ACARA UJIAN TESIS

Pada hari Jumat tanggal 28 September 2018 Program Studi Manajemen Program Magister, Fakultas Ekonomi Universitas Islam Indonesia telah mengadakan ujian tesis yang disusun oleh :

MIFTA FITRIYANA

No. Mhs. : 16911034

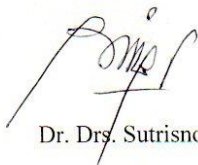
Konsentrasi : Manajemen Keuangan

Dengan Judul:

**FENOMENA ANOMALI PASAR PADA PERUSAHAAN LQ 45
DI BURSA EFEK INDONESIA TAHUN 2017**

Berdasarkan penilaian yang diberikan oleh Tim Penguji, maka tesis tersebut dinyatakan **LULUS**

Penguji I



Dr. Drs. Sutrisno, MM.

Penguji II



Dr. D. Agus Harjito, M.Si.

Mengetahui

Ketua Program Studi Magister Manajemen,



Dr. Dwi Praptono Agus Harjito, M.Si.

Kata Pengantar

Assalamualaikum Wr. Wb

Puji Syukur penulis panjatkan kehadiran Allah SWT, yang Maha Pengasih dan Maha Penyayang, atas limpahan rahmat dan karunia-Nya. Shalawat serta salam penulis tujukan kepada Nabi Muhammad saw beserta para sahabat dan keluarga. Alhamdulillah segala syukur akhirnya terselesaikan juga penulisan tesis ini yang berjudul : “FENOMENA ANOMALI PASAR PADA PERUSAHAAN LQ 45 DI BURSA EFEK INDONESIA TAHUN 2017”. Penulisan tesis ini untuk memenuhi sebagian persyaratan mencapai derajat Sarjana Strata – 2 Program Magister Manajemen pada Universitas Islam Indonesia.

Sehubungan dengan itu penyelesaian tesis ini sangat banyak mendapatkan bantuan dari berbagai pihak, sehingga pada kesempatan ini penulis ingin menyampaikan rasa terimakasih yang tak terhingga kepada:

1. Bapak Dr. Drs. Sutrisno, MM, selaku dosen pembimbing tesis yang telah meluangkan waktunya untuk membimbing dan mengarahkan serta membrikan pemahaman selama penulis dalam melaksanakan penulisan tesis ini hingga selesai.
2. Bapak Dr. Agus Harjito, M.Si, selaku dosen penguji yang telah banyak memberikan masukan dalam penulisan tesis.
3. Para tenaga pengajar dan seluruh staff MM UII yang telah banyak membantu dalam masa kuliah maupun penulisan tugas akhir.
4. Untuk bapak mama tersayang yang memberikan motivasinya, doanya, kasih sayang yang tidak terhenti – henti.
5. Kakak Kakak tersayangku mbak nety, mas yanto, mas hifni, mbak rima, mbak nana, mas candra, mas arif, mbak mala, mbak mala kecil, mas dany, dan si adik kecil si rasyid.
6. Untuk keponakan – keponakan tante tersayang.
7. Untuk calon suamiku, mas anas wahyudi terimakasih atas dukungan serta doa yang selalu tercurahkan untuk dinda.
8. Teman – teman al yamin yang selalu ada dihati meskipun jarak antar kota dan pulau yang sekarang sangat jauh, (Lina, Ain, Eva, Om kiki, Bobi, Arif) terimakasih untuk selalu mengajarku menjadi yana.
9. Teman – teman geng venirose tersayang (Kak rara. Tifa, Restin, Inggar) yang selalu menyemangati dan menemani.

10. Teman – teman MM 47 B yang sudah selalu menjadi teman belajar, bermain, dan memberikan banyak hal yang indah selama kuliah s2.
11. Dan pihak – pihak lain yang telah membantu baik moril maupun spiritual dalam masa – masa kuliah maupun dalam penyusunan tesis sehingga terselesaikan dengan baik.

Peneliti menyadari sepenuhnya bahwa tesis ini tidak lepas dari kekurangan. Hal ini disebabkan karena keterbatasan pengetahuan dan kemampuan saya sebagai peneliti dalam menyelesaikan tesis ini. Karena itu saya bersedia menerima kritik dan saran dari semua pihak. Peneliti berharap dengan selesainya tesis ini akan memberikan masukan, gagasan, dan pemikiran lebih lanjut bagi pihak – pihak yang membutuhkannya dan bagi yang akan mengadakan penelitian lebih lanjut.

Yogyakarta, 27 September 2018

Mifta Fitriyana

HALAMAN PERSEMBAHAN

Kupersembahkan untuk..

Bapak Wanani Zaini & Ibu Setyo Suharti.....