

Analisis Pengaruh Fenomena *January Effect* dan *Monday Effect* Pada Return
Perusahaan Yang Terdaftar Sebagai Indeks LQ-45 Di Bursa Efek Indonesia
Periode 2015-2018

SKRIPSI

Ditulis dan diajukan untuk memenuhi syarat ujian akhir guna
memperoleh gelar sarjana strata-1 di Jurusan Manajemen,
Fakultas Ekonomi, Universitas Islam Indonesia

Oleh:

Nama : Nadine Cindi Karissanata
Nomor Mahasiswa : 15311309
Jurusan : Manajemen
Bidang Konsentrasi : Keuangan



UNIVERSITAS ISLAM INDONESIA

FAKULTAS EKONOMI

YOGYAKARTA

2019

PERNYATAAN BEBAS PLAGIARISME

“Dengan ini saya menyatakan bawa dalam skripsi ini tidak terdapat karya yang pernah diajukan orang lain untuk memperoleh gelar sarjana 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 di kemudian hari terbukti bahwa ini tidak benar, saya sanggup menerima hukuman atau sanksi apapun sesuai peraturan yang berlaku”

Yogyakarta, 4 Juli 2019

Penulis,



Nadine Cindi Karissanata

HALAMAN PENGESAHAN

ANALISIS PENGARUH FENOMENA *JANUARY EFFECT* DAN *MONDAY EFFECT* PADA RETURN PERUSAHAAN YANG TERDAFTAR SEBAGAI INDEKS LQ-45 DI BURSA EFEK INDONESIA PERIODE 2015-2018

SKRIPSI

ISLAM

Diajukan Oleh:

Nama : Nadine Cindi Karissanata
Nomor Mahasiswa : 15311309
Jurusan : Manajemen
Bidang Konsentrasi : Keuangan

Yogyakarta, 4 Juli 2019

Telah disetujui dan disahkan oleh

Dosen Pembimbing

Kartini, Dra., M.Si.

BERITA ACARA UJIAN TUGAS AKHIR /SKRIPSI

SKRIPSI BERJUDUL

**ANALISIS PENGARUH FENOMENA JANUARY EFFECT DAN MONDAY EFFECT PADA
RETURN PERUSAHAAN YANG TERDAFTAR SEBAGAI INDEKS LQ-45 DI BURSA EFEK
INDONESIA PERIODE TAHUN 2015-2018**

Disusun Oleh : NADINE CINDI KARISSANATA

Nomor Mahasiswa : 15311309

Telah dipertahankan di depan Tim Penguji dan dinyatakan **LULUS**

Pada hari Rabu, tanggal: 7 Agustus 2019

Penguji/ Pembimbing Skripsi : Kartini, Dra., M.Si.

Penguji : Sutrisno, Dr., Drs., MM.

Mengetahui
Dekan Fakultas Ekonomi
Universitas Islam Indonesia



Jaka Snyana, SE., M.Si, Ph.D.

PERSEMBAHAN

Skripsi ini dipersembahkan untuk:

1. Orang tuaku tersayang dan tercinta, Ayah Didik dan Mama Indira yang selalu bertanya-tanya sampai ditahap mana skripsi ini berjalan, tetapi selalu diiringi memberiku semangat, dukungan, hiburan, serta doa yang luar biasa kepadaku sehingga aku bisa menyelesaikan studiku tepat waktu.
2. Adikku yang ganteng, Adam Aabid Indranata. Yang selalu mengajakku bercanda dan menghiburku dan selalu berlaku *so sweet* kepadaku, kapanpun dan dimanapun. Semoga skripsi ini bisa menjadi semangatmu untuk cepat menyelesaikan studimu. Semangat, Pak Listrik!

MOTTO

“In order to succeed, your desire for success should be greater than your fear of failure”



KATA PENGANTAR

Assalamualaikum Wr.Wb.

Puji syukur bagi Allah SWT, Tuhan semesta alam serta junjungan besar Nabi Muhammad SAW yang telah melimpahkan rahmat dan hidayahnya sehingga penulis dapat menyelesaikan skripsi yang berjudul “Analisis Pengaruh Fenomena *January Effect* dan *Monday Effect* Pada Return Perusahaan Yang Terdaftar Sebagai Indeks LQ-45 Di Bursa Efek Indonesia Periode 2015-2018”. Skripsi ini disusun guna melengkapi persyaratan dalam menyelesaikan studi pada Program Sarjana (S1) Manajemen Fakultas Ekonomi Universitas Islam Indonesia.

Dalam proses penyusunan skripsi, penulis mengalami banyak kendala, terutama saat proses penulisan proposal (bab 1-3). Namun, penulis tetap semangat dan pantang menyerah dalam menyelesaikan skripsi ini. Penulisan skripsi ini tidak lepas dari bantuan, dukungan, dan doa dari berbagai pihak. Oleh karenanya, atas selesainya skripsi ini penulis mengucapkan Terima kasih kepada :

1. Allah SWT yang senantiasa baik dan tiada hentinya menunjukkan kebesarannya, selalu menuntun langkahku dan memberi kemudahan serta kelancaran dalam penulisan skripsi ini.
2. Ibu Kartini, Dra., M.Si. selaku dosen pembimbingku yang selalu sabar dan ikhlas meluangkan waktunya untuk memberikan arahan dan nasehat dalam penyusunan skripsi ini.

3. Seluruh Bapak dan Ibu dosen prodi Manajemen Fakultas Ekonomi Universitas Islam Indonesia yang telah memberikan ilmu dan wawasan kepada penulis, baik saat dalam perkuliahan maupun di luar perkuliahan.
4. Orang tuaku, Ayah Didik Srinoto dan Mama Indirawati Fairwandari. Terima kasih atas kasih sayang dan cinta kalian, terima kasih atas doa-doa yang telah dipanjatkan untukku, dan dukungan financial selama ini sehingga aku bisa sampai di tahap ini.
5. Adikku tergantung, Adam Aabid Indranata, terima kasih atas candaan-candaan yang selalu bisa membuatku kangen rumah sehingga memberiku semangat untuk lebih giat menyelesaikan skripsi ini agar aku dapat segera pulang ke rumah.
6. Mbah Kung dan Mbah Uti Jakarta dan Kediri yang selalu mendoakan dan mendukung setiap langkahku.
7. Rahmat Agung Nuswantoro, teman yang selalu ada untukku sehingga menjadikan kita teman dekat. Terima kasih atas waktunya, atas kesabarannya menghadapi keluh kesahku, dan terima kasih atas cerita-cerita dari pengalaman hidupmu, wawasanmu yang selalu membuatku takjub dan belajar untuk menerima sudut pandang dari orang lain.
8. Teman – teman kuliahku, Bu Mentor Dian, Mela, Rhenanda, Dewi, Jeje, Silvi, Nabel, dan Ida. Terima kasih karena telah menemani hari – hari perkuliahanku di Jogja, yang selalu meramaikan kamarku dan tiada hari tanpa merepotkan diriku.

Serta semua pihak yang telah membantu dalam penyusunan skripsi ini, yang tidak bisa disebutkan satu persatu, semoga bimbingan dan bantuan yang telah diberikan kepada penulis mendapatkan imbalan dari Allah SWT. Masih banyak kekurangan yang terdapat dalam skripsi ini, oleh karenanya penulis mengharapkan kritik dan saran sebagai masukan. Kemudian, apabila terjadi kesalahan terkait materi maupun teknik dan penulisannya penulis memohon maaf yang sebesar – besarnya. Akhir kata semoga apa yang ada dalam skripsi ini dapat bermanfaat bagi pihak yang berkepentingan.

Wassalamualaikum Wr. Wb.

Yogyakarta, 4 Juli 2019

Nadine Cindi Karissanata