

**ANALISA HUBUNGAN ABNORMAL RETURN DAN RISIKO
SISTEMATIS PADA SAHAM PERUSAHAAN MANUFAKTUR
DI BURSA EFEK JAKARTA**

(Periode Januari - Desember 2004)

SKRIPSI

Diajukan Untuk Memenuhi Sebagai Persyaratan Guna Memperoleh
Gelar Sarjana Ekonomi Pada Fakultas Ekonomi
Universitas Islam Indonesia Yogyakarta

Oleh :

Nama Mhs : IRA NOVRIANY

No. Mhs : 98 312 328

Jurusan : AKUNTANSI

**FAKULTAS EKONOMI
UNIVERSITAS ISLAM INDONESIA
YOGYAKARTA**

2006

HALAMAN PERSEMBAHAN

Dengan rasa penuh cinta

Ku persembahkan hasil karya ini teruntuk :

Papa dan Mama Tercinta, yang telah membesarkan dan mendidik "anakmu"
dengan perjuangan dan kerja keras" terima kasih atas doa dan kasih sayangmu
Kakak dan Adikku Silvia Merriany & Andriany terima kasih atas bantuan dan
kasih sayangnya yang kalian berikan

Dodi Bayu Harsono, semoga dengan kehadiranmu dapat menjadikan perubahan
yang lebih baik dalam kehidupanku.

3. Ibu Erna Hidayah, Dra. M.Si, Ak selaku Ketua Jurusan Akuntansi Fakultas

Ekonomi Universitas Islam Indonesia.

4. Kedua orang tuaku tercinta, kakak dan adikku Silvia Merriany & Andriany terima kasih telah memberikan doa, dukungan dan dorongan selama ini sehingga dapat terselesaikan penyusunan skripsi ini.

5. Dodi Bayu Harsono, terima kasih atas kasih sayang dan dorongannya.

6. Segenap teman-teman seperjuangan angkatan 98, Bambang, Kunto, Ipu'i, Ade,

Ririn terima kasih atas kerja sama dan bantuannya.

7. Akhirnya kepada semua pihak yang tidak dapat penyusun sebutkan satu persatu, yang turut membantu penyusun dalam belajar di Universitas Islam Indonesia Yogyakarta

Akhir kata, penulis berharap agar skripsi ini dapat bermanfaat bagi pihak yang berkepentingan. Kritik dan saran sangat diharapkan oleh penulis demi kesempurnaan skripsi ini.

Wassalamu'alaikum wr. wb

Yogyakarta, 2006

Ira Novriany