

## PERNYATAAN BEBAS PLAGIARISME

“Dengan ini saya menyatakan bahwa dalam skripsi ini tidak terdapat karya yang pernah diajukan orang lain 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 kemudian hari terbukti bahwa pernyataan ini tidak benar, saya sanggup menerima hukuman/sanksi apapun sesuai peraturan yang berlaku.”

Yogyakarta, 5 Agustus 2008

Penulis,



Rudy Wahyu Jamiko

UNIVERSITAS ISLAM INDONESIA  
UNIVERSITAS ISLAM INDONESIA  
UNIVERSITAS ISLAM INDONESIA

## **Analisis January Effect terhadap**

### **Return Saham di Bursa Efek Jakarta periode 2003-2007**

**(studi kasus pada 15 perusahaan besar dan 15 perusahaan kecil)**



Nama : Rudy Wahyu Jatmiko  
Nomor Mahasiswa : 04311356  
Program Studi : Manajemen  
Bidang Konsentrasi : Keuangan

Yogyakarta, 5 Agustus 2008

Telah disetujui dan disahkan oleh:

Dosen Pembimbing,



Drs. Sutrisno, MM.

**BERITA ACARA UJIAN SKRIPSI**

**SKRIPSI BERJUDUL**

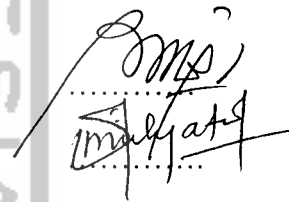
**Analisis January Effect Terhadap Return Saham di Bursa Efek  
Jakarta Periode 2003 - 2007 (Studi Kasus Pada 15 Perusahaan  
Besar dan 15 Perusahaan Kecil)**

Disusun Oleh: RUDY WAHYU JATMIKO  
Nomor Mahasiswa: 04311356

Telah dipertahankan di depan Tim Penguji dan dinyatakan LULUS  
Pada tanggal : 15 September 2008

Penguji/Pemb. Skripsi : Drs. Sutrisno, MM

Penguji : Dra. Sri Mulyati, M.Si



Mengetahui  
Dekan Fakultas Ekonomi  
Universitas Islam Indonesia



Drs. Asmaul Ashak, M.Bus, Ph.D

## KATA PENGANTAR

*Assalamu'alaikum wr. Wb*

Alhamdulillah puji syukur yang sedalam-dalamnya penulis panjatkan atas kehadiran Allah SWT yang telah memberikan rahmat, hidayah dan inayah-Nya sehingga penulis dapat menyelesaikan skripsi yang berjudul “**Analisis January Effect terhadap Return Saham di Bursa Efek Jakarta periode 2003-2007** (studi kasus pada 15 perusahaan besar dan 15 perusahaan kecil)” ini dengan lancar.

Adapun tujuan penelitian ini merupakan tugas akhir yang penulis susun untuk memenuhi persyaratan ujian akhir guna memperoleh gelar Sarjana Strata-1 di Program Studi Manajemen Fakultas Ekonomi Universitas Islam Indonesia.

Dalam penulisan skripsi ini penulis banyak mendapatkan bantuan berupa bimbingan dan pengarahan dari berbagai pihak. Untuk itu pada kesempatan ini penulis banyak mengucapkan terima kasih kepada:

1. Kedua orangtuaku (Heru Saputro & Widiastuti). Terima kasih atas segala-galanya, semoga saya bisa memberikan yang terbaik bagi keluarga.
2. Bapak Prof. Dr. Edy Suandi Hamid, M.Ec. selaku Rektor Universitas Islam Indonesia.
3. Bapak Drs. H. Asma'i Ishak, M.Bus., Ph.D. selaku Dekan Fakultas Ekonomi Universitas Islam Indonesia.
4. Bapak Dr. Zaenal Arifin, M.Si. selaku Ketua Program Studi Manajemen Fakultas Ekonomi Universitas Islam Indonesia.
5. Bapak Drs. Sutrisno, MM. selaku dosen pembimbing yang telah banyak memberikan pengarahan dan masukan kepada penulis dalam proses penyelesaian skripsi ini.
6. Seluruh dosen dan karyawan Fakultas Ekonomi Universitas Islam Indonesia.
7. Mas Gatot, Mas Tommy, dan seluruh keluarga yang telah memberikan dorongan dan harapan.

8. Tante Rita Hanurati (alm) dan mbah Samiyat (alm), terima kasih atas perhatiannya.
9. Teman-temanku "d'Sakinah Family": Adib (thx buku SPSSnya), Bitink (my boyFriend) Bontang, Didith, Farah, Hezty, Jay, Neni, Paw (my soulmate), Topik. I Love U All!
10. Semua teman-teman di Fakultas Ekonomi UII
11. Keluarga Management Community FE UII
12. Keluarga Karang Taruna "Citra Bhakti" Klaten. Selamat tinggal... ayo terus maju!
13. Aditya Fitrianto, thank u bro! semoga langgeng sama Erbi.
14. Laptopku (Aspire 4520), printerku (Canon iP1880), USBku (Kingstone 1GB). Kalian semua pekerja keras, salut buat kalian.
15. Mas Dodo, terima kasih atas saran yang diberikan. Dan semua pihak yang telah memberikan dukungan sehingga penulis dapat menyelesaikan skripsi ini.

Penulis menyadari penyusunan ini masih jauh dari sempurna. Untuk itu saran serta kritik yang membangun sangat penulis harapkan. Semoga karya ini dapat bermanfaat bagi kita semua. Amin

Yogyakarta, Agustus 2008



Penulis