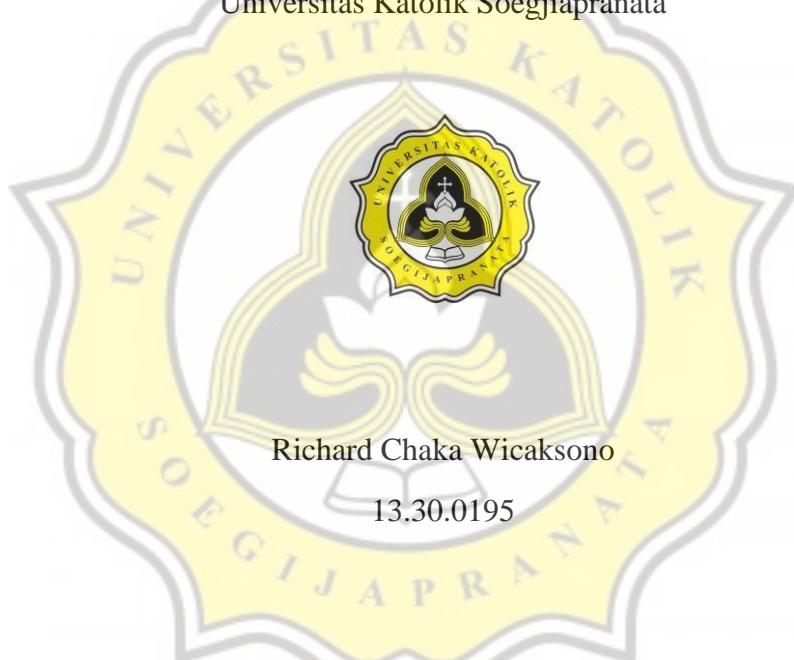


**PENGARUH PENANGGALAN JAWA TERHADAP RETURN
SAHAM (STUDI KASUS PADA SAHAM PERUSAHAAN
FOOD & BEVERAGES DI BURSA EFEK INDONESIA)**

SKRIPSI

Diajukan untuk memenuhi syarat guna mencapai gelar Sarjana
Pada Program Studi Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis

Universitas Katolik Soegijapranata



**PROGRAM STUDI MANAJEMEN
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS
UNIVERSITAS KATOLIK SOEGIJAPRANATA
SEMARANG**

2019

HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS

Saya yang bertanda tangan di bawah ini

Nama : Richard Chaka Wicaksono

NIM : 13.30.0195

Menyatakan dengan sesungguhnya bahwa Skripsi yang berjudul "**Pengaruh Penanggalan Jawa Terhadap Return Saham (Studi Kasus Pada Saham Perusahaan Food & Beverage Di Bursa Efek Indonesia)**" adalah hasil penelitian saya dengan supervise dosen pembimbing, dan bukan hasil plagiat. Saya bertanggung jawab atas keaslian dan kebenaran isinya sesuai dengan sikap ilmiah yang harus dijunjung tinggi.

Demikian pernyataan ini saya buat dengan sebenarnya, tanpa ada tekanan dan paksaan dari pihak manapun serta bersedia mendapat sanksi akademik jika ternyata dikemudian hari pernyataan ini tidak benar.

Semarang, 27 Oktober 2019

Yang menyatakan,



Richard Chaka Wicaksono

HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI

Nama : Richard Chaka Wicaksono
NIM : 13.30.0195
Fakultas : Ekonomi dan Bisnis
Program Studi : Manajemen
Judul : **PENGARUH PENANGGALAN JAWA TERHADAP
RETURN SAHAM (STUDI KASUS PADA SAHAM
PERUSAHAAN FOOD & BEVERAGE DI BURSA
EFEK INDONESIA)**

Dosen Pembimbing : DR. Widuri Kurniasari, SE.MSI.

Disetujui di Semarang, Oktober 2019

Dosen Pembimbing

DR. Widuri Kurniasari, SE.MSI.

HALAMAN PENGESAHAN SKRIPSI

Yang bertanda tangan dibawah ini menyatakan bahwa skripsi dengan judul :

“Pengaruh Penanggalan Jawa Terhadap Return Saham (Studi Kasus Pada Saham Perusahaan Food & Beverage Di Bursa Efek Indonesia)”

Yang disusun oleh

Nama : Richard Chaka Wicaksono

NIM : 13.30.0195

Fakultas : Ekonomi dan Bisnis

Program Studi : Manajemen

telah dipertahankan dihadapan Tim Pengaji pada Oktober 2019 dan diterima sebagai bagian pesyaratan yang diperlukan untuk memperoleh gelar Sarjana pada Program Studi Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Katolik Soegijapranata

Pengaji 1

Pengaji 2

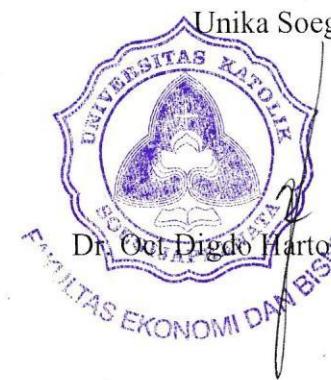
Pengaji 3

(DR. Widuri Kurniasari , SE.MSI.) (Y. Wisnu Djati Sasmito, SE.MSI.) (Drs. B. Junianto Wibowo, MSM.)

Mengetahui,

Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis

Unika Soegijapranata



Dr. Oct. Digdo Hartomo, SE., M.Si., Akt.

KATA PENGANTAR

Puji syukur kepada Tuhan Yang Maha Esa, karena atas berkat dan karunia-Nya sehingga penulis dapat menyelesaikan skripsi dengan judul “Pengaruh Penanggalan Jawa Terhadap Return Saham (Studi Kasus Pada Saham Perusahaan Food & Beverages Di Bursa Efek Indonesia)”. Skripsi ini disusun untuk memenuhi syarat guna memperoleh gelar Sarjana Ekonomi pada Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Katolik Soegijapranata Semarang.

Pada kesempatan kali ini penulis ingin menyampaikan rasa terima kasih yang sebesar-besarnya kepada:

1. Tuhan Yesus Kristus yang selalu memberi kekuatan dan perlindungan kepada penulis dalam segala hal, serta berkat dan anugrah yang diberikan kepada penulis.
2. Kedua orang tua saya yang selalu memberikan support kepada saya tanpa henti sehingga akhirnya saya penulis dapat menyelesaikan skripsi ini dengan baik.
3. Ibu Dr. Oct. Digdo Hartomo, SE, Msi., Akt, CPA selaku Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis atas ijinya kepada penulis untuk menggunakan fasilitas yang ada di Fakultas Ekonomi dan Bisnis.
4. Ibu Dr. Widuri Kurniasari, SE, MSi selaku Dosen Pembimbing yang selalu sabar membimbing, mengarahkan, mengingatkan serta meluangkan waktu di sela-sela kesibukan untuk melakukan diskusi dengan penulis.
5. Bapak Y. Wisnu Djati Sasmito, SE, MSi dan Bapak Drs. B. Junianto Wibowo, MSM, selaku Dosen Pengaji yang telah memberikan waktu luang, arahan, masukan dan juga memberikan ilmu yang sangat berguna bagi penulis.
6. Kedua Teman saya Armelia Maharani, SE, dan Mentari Citra Puspita Sari, SE, yang selalu memberikan suport yang sangat banyak kepada saya selaku penulis dari segi ilmu pengalaman dan beberapa fasilitas sehingga penulis dapat menyelesaikan skripsi ini.

HALAMAN PERNYATAAN PERSETUJUAN PUBLIKASI SKRIPSI UNTUK KEPENTINGAN AKADEMIS

Sebagai sivitas akademik Universitas Katolik Soegijapranata, saya yang bertanda tangan di bawah ini :

Nama : Richard Chaka Wicaksono

NIM : 13.30.0195

Program Studi : Manajemen

Fakultas : Ekonomi dan Bisnis

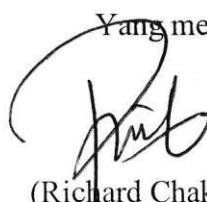
Demi pengembangan ilmu pengetahuan, menyetujui untuk memberikan kepada Universitas Katolik Soegijapranata Hak Bebas Royalti Nonekslusif (*Non-exclusive Royalty-Free Right*) atas skripsi yang berjudul :

“Pengaruh Penanggalan Jawa Terhadap Return Saham (Studi Kasus Pada Saham Perusahaan Food & Beverage Di Bursa Efek Indonesia)”. Dengan Hak Bebas Royalti Nonekslusif ini Universitas Katolik Soegijapranata berhak menyimpan, mengalihmedia /formatkan, mengelola dalam bentuk pangkalan data (*database*), merawat, dan memublikasikan skripsi di atas dengan mencantumkan nama saya sebagai penulis.

Demikian pernyataan ini saya buat dengan sebenarnya.

Dibuat di : Semarang

Pada Tanggal : Oktober 2019

Yang menyatakan

(Richard Chaka Wicaksono)

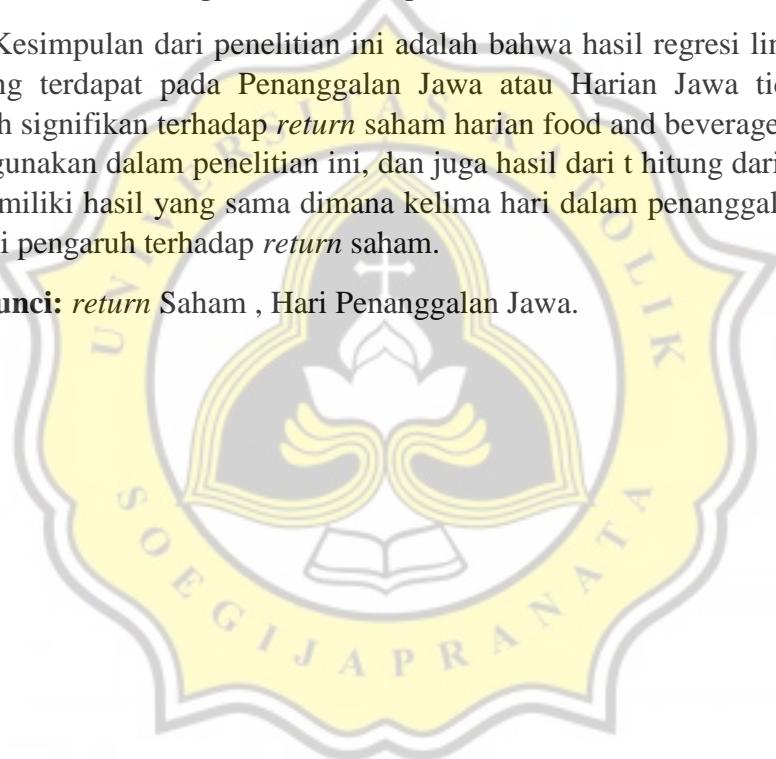
Abstrak

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui Pengaruh Hari Penanggalan Jawa Terhadap Return Saham pada Perusahaan Food & Beverage di Bursa Efek Indonesia.

Populasi yang digunakan dalam penelitian ini adalah seluruh perusahaan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia dan bergerak di Bidang Food & Beverages pada tahun 2016. alat uji yang digunakan dalam penelitian ini regresi linier sederhana, dimana alat uji ini digunakan untuk menguji pengaruh suatu variabel bebas atau variabel independent terhadap variabel terikat.

Kesimpulan dari penelitian ini adalah bahwa hasil regresi linier dari lima hari yang terdapat pada Penanggalan Jawa atau Harian Jawa tidak memiliki pengaruh signifikan terhadap *return* saham harian food and beverage pada periode yang digunakan dalam penelitian ini, dan juga hasil dari t hitung dari regresi linier juga memiliki hasil yang sama dimana kelima hari dalam penanggalan jawa tidak memiliki pengaruh terhadap *return* saham.

Kata Kunci: *return* Saham , Hari Penanggalan Jawa.



Abstract

This Study Have a purpose to find the impact of Javaness Calendar to Stock Return in Food and Beverage Company on Indonesia Stock Market.

The population that used on this study are all the company that works in Food and Beverages sector and listed in Indonesia Stock Exchange in 2016. The test tool used in this study is a simple linear regression, where this test tool is used to test the effect of an independent variable or independent variable on related variables

The conclusion of this study is that the results of the linear regression of five days contained in the Javanese calendar or daily Javanese have no significant effect on the daily stock returns of food and beverages in the period used in this study, and also the results of the t count from the linear regression also have the results the same where the fifth day of the Javanese calendar has no effect on stock returns

Key Words: *Stock Return, Javaness Calendar.*

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS.....	ii
HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI.....	iii
HALAMAN PENGESAHAN SKRIPSI.....	iv
KATA PENGANTAR	v
HALAMAN PERNYATAAN PERSETUJUAN PUBLIKASI.....	vii
ABSTRAK	viii
ABSTRACT	ix
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR TABEL.....	xii
BAB I. PENDAHULUAN	1
1.1. LATAR BELAKANG	1
1.2. RUMUSAN MASALAH.....	7
1.3. TUJUAN PENELITIAN.....	7
1.4. MANFAAT PENELITIAN	7
BAB II. LANDASAN TEORI.....	9
2.1. KALENDER JAWA.....	9
2.2. SAHAM	14
2.3. RETURN SAHAM	15
2.4. DIVIDEN	17
2.5. POLA WAKTU RETURN SAHAM.....	18
2.6. ANOMALI PASAR MODAL	19
2.7. PENDEKATAN ALAISIS SAHAM	20
2.8. PENELITIAN TERDAHULU.....	20
2.9. KERANGKA PIKIR PENELITIAN	22

2.10. PENGEMBANGAN HIPOTESIS	23
BAB III. METODE PENELITIAN.....	25
3.1. POPULASI DAN SAMPEL.....	25
3.2. JENIS DAN SUMBER DATA.....	26
3.3 METODE PENGUMPULAN DATA.....	26
3.4. METODE ANALISIS DATA.....	27
3.5. PENGUJIAN HIPOTESIS.....	28
3.6. KRITERIA PENERIMAAN HIPOTESIS.....	28
BAB IV. ANALISIS DATA.....	30
4.1. STATISTIK DESKRIPTIF.....	30
4.2. HASIL ANALISIS DATA	32
BAB V. PENUTUP.....	38
5.1. KESIMPULAN	38
5.2. KETERBATASAN PENELITIAN	39
5.3. SARAN	39
Daftar Pustaka	41