

**PERBEDAAN *RETURN* SAHAM PADA *MONDAY EFFECT*  
DI *JAKARTA ISLAMIC INDEX (JII)***

**DIAJUKAN UNTUK MEMENUHI SEBAGIAN PERSYARATAN  
DALAM MEMPEROLEH GELAR SARJANA EKONOMI ISLAM  
PROGRAM STUDI EKONOMI ISLAM  
DEPARTEMEN EKONOMI SYARIAH**



**DIAJUKAN OLEH  
WILDAN ADITYA NUGRAHA  
NIM: 041014111**

**FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS  
UNIVERSITAS AIRLANGGA  
SURABAYA  
2015**

**SKRIPSI**

**PERBEDAAN RETURN SAHAM PADA MONDAY EFFECT  
DI JAKARTA ISLAMIC INDEX (JII)**

**DIAJUKAN OLEH:**

**WILDAN ADITYA NUGRAHA  
NIM: 041014111**

**TELAH DISETUJUI DAN DITERIMA DENGAN BAIK OLEH**

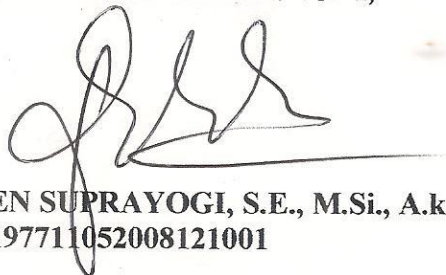
**DOSEN PEMBIMBING,**



**Dr. LEO HERLAMBAANG, SE., MM.  
NIP. 196902282008121002**

**TANGGAL** ..... 13 AGUSTUS 2015

**A.N KETUA PROGRAM STUDI,**



**NOVEN SUPRAYOGI, S.E., M.Si., A.k.  
NIP. 197711052008121001**

**TANGGAL** ..... 13 AGUSTUS 2015

## PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI

Saya, (Wildan Aditya Nugraha, 041014111), menyatakan bahwa:

1. Skripsi saya ini adalah asli dan benar-benar hasil karya saya sendiri, dan bukan hasil karya orang lain dengan mengatasnamakan saya, serta bukan merupakan hasil peniruan atau penjiplakan (*plagiarism*) dari karya orang lain. Skripsi ini belum pernah diajukan untuk mendapatkan gelar akademik baik di Universitas Airlangga, maupun di perguruan tinggi lainnya.
2. Dalam skripsi ini tidak terdapat karya atau pendapat yang telah ditulis atau dipublikasikan orang lain, kecuali secara tertulis dengan jelas dicantumkan dalam daftar kepustakaan.
3. Pernyataan ini saya buat dengan sebenar-benarnya, dan apabila di kemudian hari terdapat penyimpangan dan ketidakbenaran dalam pernyataan ini, maka saya bersedia menerima sanksi akademik berupa pencabutan gelar yang telah diperoleh karena karya tulis Skripsi ini, serta sanksi-sanksi lainnya sesuai dengan norma dan peraturan yang berlaku di Universitas Airlangga.

Surabaya, 13 AGUSTUS 2015



Wildan Aditya Nugraha

NIM. 041014111

## DECLARATION

I, (Wildan Aditya Nugraha, 041014111), declare that:

1. My thesis is genuine and truly my own creation, and is not another's person work made under my name, nor piracy or plagiarism. This thesis has never been submitted to obtain an academic degree in Airlangga University or in any other University/colleges.
2. This thesis does not contain any work or opinion written or published by anyone, unless clearly a knowledge or referred to by quoting the author's name or stated in the References.
3. This statement is true; if on the future this statement is proven to be fraud and dishonest, I agree to receive an academic sanction in the form of removal of the degree obtained through this thesis, and other sanction in accordance with the prevailing norms and regulations in Airlangga University.

Surabaya, *13 AGUSTUS 2015* .....



Wildan Aditya Nugraha

NIM. 041014111

## KATA PENGANTAR

Segala puji bagi syukur penulis panjatkan atas kehadiran Allah SWT atas segala rahmat, karunia iman dan cinta-Nya penulis dapat menyelesaikan penulisan skripsi ini dengan lancar. Shalawat serta salam semoga senantiasa tercurahkan kepada manusia terbaik sepanjang zaman, Rasulullah Muhammad SAW, keluarganya dan para sahabatnya.

Skripsi dengan judul “**Perbedaan Return Saham Pada Monday Effect di Jakarta Islamic Index (JII)**” ini ditulis untuk memenuhi sebagian persyaratan akademik untuk mendapatkan gelar Sarjana Ekonomi Islam Program Studi Ekonomi Islam, Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Airlangga Surabaya.

Menyadari bahwa penulisan ini masih jauh dari kata sempurna. Penyusunan skripsi ini tidak terlepas dari peran banyak pihak baik secara langsung maupun tidak langsung dalam membantu penulis sebelum dan selama penulisan skripsi. Oleh karena itu pada kesempatan ini, penulis ingin menyampaikan penghargaan dan ucapan terima kasih tidak terhingga kepada:

1. Bapak Prof. Dr. H. Muslich Anshori, S.E, M.Si, Ak. selaku Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Airlangga periode 2010-2015.
2. Bapak Dr. Muhammad Nafik H.R., S.E., M.Si. selaku Ketua Departemen Ekonomi Syariah dan Program Studi Ekonomi Islam Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Airlangga periode 2010-2013.

3. Bapak Drs. Ec. H. Suherman Rosyidi, M.Com., selaku Ketua Departemen Ekonomi Syariah dan Program Studi Ekonomi Islam Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Airlangga periode 2013-2014.
4. Bapak Noven Suprayogi, S.E, M.Si., Ak., selaku Sekretaris Departemen Ekonomi Syariah Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Airlangga.
5. Bapak Dr. Leo Herlambang, S.E., M.M selaku dosen pembimbing skripsi yang telah bersedia menyediakan waktu dan dengan sabar memberi bimbingan, saran dan membangun keyakinan dalam proses penyelesaian skripsi. Banyak hal yang beliau lakukan baik dengan lingkungan maupun dengan keluarga yang layak penulis contoh.
6. Bapak Dr. Leo Herlambang, S.E., M.M, bapak Dr. Muhammad Nafik Hadi Ryandono, SE., M.Si. ibu Dina Fitriasia S. S.E., M.M.,Ak, bapak Syifaul Qulub, S.Ag., M.El., yang telah bersedia menjadi penguji pada sidang proposal sehingga kritik dan sarannya dapat membantu penulis memperbaiki kesalahan-kesalahan dalam penulisan skripsi.
7. Ibu Dr. Ririn Tri Ratnasari, S.E, M.Si., selaku dosen wali, ibu Dr. Tika Widiastuti, SE., M.Si., ibu Dr. Sri Herianingrum, SE., M.Si, ibu Nisful Laila, SE., M.Com., ibu Puji Sucia Sukmaningrum, SE., C.I.F.P., yang telah banyak memberikan dukungan, nasihat, semangat selama penulis menjadi mahasiswa. Serta seluruh staf pengajar Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Airlangga terkhusus pada staf pengajar Departemen Ekonomi Islam yang telah memberikan ilmu dan bimbingannya tentang ilmu ekonomi Islam dari berbagai perspektif.

8. Bapak Kasdullah, bapak Syaiful Bachri, S.Pd.I., ibu Dewi, Jajaran pimpinan beserta staf Akademik, Kemahasiswaan, Ruang Baca Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Airlangga yang telah banyak membantu proses administrasi selama masa studi.
9. Ayah Pole dan Ibu Nurasih yang sangat penulis cintai, segala puji bagi Allah SWT yang telah memberikan kedua orang tua luar biasa untuk penulis, karena segala doa, motivasi dan pemberian teriring cinta yang tak pernah putus dan tak pernah mampu terbalaskan.
10. Widyan Indra Cahya, Dwi Maharani, Widen Lukmantono, dan Rima Puspita Dwi Andini, kakak-kakak luar biasa yang menjadi semangat penulis untuk senantiasa berbenah dan memberikan tauladan yang baik yang dapat dicontoh oleh penulis.
11. Sahabat-sahabat SMA penulis, Yohanes Visantus Wicaksono, Syifa Alam, Dio Alief Pranata, Dikri Ramandana, Mohammad Indaryana, Fasha Heykal, Barok Argashabri Aji, Archie Gutama, terimakasih atas segala dukungan, teguran, kasih sayang, pelajaran-pelajaran dalam memaknai hidup dan menorehkan cerita indah selama ini. Semoga Allah berkenan mempertemukan kita kembali sampai nanti di Jannah-Nya.
12. Teman-teman Ekonomi Islam 2010, Baidhowi, Bayu, Dennis, Deri, Doni, Firmansyah, Gian, Herwindo, Hero, Imam, Irul, Jefri, Prika, Reza, Rohmanda, Safarudin, Shohi, Tegar, Trisna, Yuan, Zaim, Anneke dan semua yang tidak dapat penulis sebutkan satu persatu, terimakasih atas bantuan, doa dan

kekeluargaan yang tercipta selama masa studi. Semoga kesuksesan dapat mengiringi kehidupan kalian setelah ini.

13. Teman-teman Ekis seperjuangan skripsi, Na'im, Vania, Alfian, Dantok, Bayu, yang telah memberikan support dalam masa-masa ini, merelakan segala kesibukannya untuk menemani dan mendoakan penulis proses penyelesaian skripsi.
14. Teman-teman HDK, Rinaldy, Donny, Yudha, Yudhi, Harindra, Saiful, Fajar, Arien, yang berkenan meluangkan waktunya untuk penulis..
15. Teman-teman, Kakak, Adik Ekonomi Islam, Manajemen, Akuntansi, Ekonomi Pembangunan 2006-2013 terimakasih atas segalanya, dan permohonan maaf atas khilaf yang pernah berlaku maupun terucap yang datang dari diri penulis, semoga Allah selalu melimpahkan rahmat dan karuniaNya untuk kalian.

Akhir kata, terimakasih kepada semua pihak yang telah banyak membantu penulis sebelum, saat dan setelah masa studi serta selama proses penyelesaian skripsi ini. Semoga Allah SWT membalas kebaikan tersebut dengan kebaikan yang lebih sempurna. Penulis mengharapkan kritik dan saran yang bersifat membangun untuk penyempurnaannya. Dengan segala keterbatasan, penulis berharap agar skripsi ini dapat memberikan manfaat bagi penulis serta pihak lain yang membutuhkannya. Semoga Allah meridhoi kita semua, Aamiin.

Surabaya, 1 Agustus 2015

Wlidan Aditya Nugraha