

SOEGIJAPRANATA CATHOLIC UNIVERSITY **Repository**

Search

[+ Advanced Search](#)

BROWSE COLLECTIONS BY



Years



Subjects



Divisions



Authors

Login

PENGARUH SANTA CLAUS RALLY TERHADAP RETURN SAHAM DI BURSA EFEK INDONESIA PERIODE 2009-2013

Prabowo, Fina Stefani Surya (2014) *PENGARUH SANTA CLAUS RALLY TERHADAP RETURN SAHAM DI BURSA EFEK INDONESIA PERIODE 2009-2013*. Other thesis, Prodi Manajemen UNIKA Soegijapranata.



Text (COVER)

10.30.0010 Fina Stefani Surya Prabowo COVER.pdf

[Download \(111kB\)](#) | [Preview](#)



Text (BAB I)

10.30.0010 Fina Stefani Surya Prabowo BAB I.pdf

Restricted to Registered users only

[Download \(63kB\)](#)



Text (BAB II Available Document Only in Soegijapranata Catholic University)

10.30.0010 Fina Stefani Surya Prabowo BAB II.pdf

Restricted to Repository staff only

[Download \(94kB\)](#)



Text (BAB III Available Document Only in Soegijapranata Catholic University)

10.30.0010 Fina Stefani Surya Prabowo BAB III.pdf

Restricted to Repository staff only

[Download \(91kB\)](#)



Text (BAB IV Available Document Only in Soegijapranata Catholic University)

10.30.0010 Fina Stefani Surya Prabowo BAB IV.pdf

Restricted to Repository staff only

[Download \(105kB\)](#)



Text (BAB V)

10.30.0010 Fina Stefani Surya Prabowo BAB V.pdf

Restricted to Registered users only

[Download \(59kB\)](#)



Text (DAFTAR PUSTAKA)

10.30.0010 Fina Stefani Surya Prabowo DAFTAR PUSTAKA & LAMP.pdf

Restricted to Registered users only

[Download \(173kB\)](#)

Abstract

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh Santa Claus Rally terhadap return saham di Bursa Efek Indonesia periode 2009-2013. Penelitian ini menggunakan metode event study, menguji abnormal return dan cumulative abnormal return 63 sampel perusahaan yang termasuk dalam indeks LQ45 selama bulan Desember – Januari tahun 2009 – 2013. Teknik analisis yang digunakan adalah uji t test sampel tunggal. Dari hasil pengolahan data disimpulkan bahwa signifikansi rata-rata abnormal return pada enam dari tujuh hari perdagangan selama periode jendela. Rata-rata cumulative abnormal return yang signifikan selama periode jendela merupakan bukti empiris yang semakin menguatkan kesimpulan bahwa Santa Claus Rally terjadi di Bursa Efek Indonesia periode 2009-2013. Penelitian ini mendukung Hirsch (1972, 2012) mengenai Santa Claus Rally yang terjadi di lima hari perdagangan terakhir di akhir tahun dan dua hari perdagangan di awal tahun baru. Keywords : Santa Claus Rally, event studies,

anomali, one sample t -test, BEI, abnormal return, dan cumulative abnormal return.

ITEM TYPE: Thesis (Other)

SUBJECTS: [300 Social Sciences > 330 Economics > Financial Economics > Stock Exchange](#)

DIVISIONS: [Faculty of Economics and Business > Department of Management](#)

DEPOSITING USER: Mrs Ratnasasi Wijayanti

USER:

DATE: 27 Aug 2015 11:26

DEPOSITED:


LAST: 30 Nov 2015 01:40

MODIFIED:

URI: <http://repository.unika.ac.id/id/eprint/637>

KEYWORDS: UNSPECIFIED

Actions (login required)

 View Item

Unika Repository supports [OAI 2.0](#) with a base URL of <http://repository.unika.ac.id/cgi/oai2>

2026 Costumed by Soegijapranata Catholic University Library.