

ABSTRACT

This research to determine whether there is any impact of the bomb Sarinah January 2016 to return abnormal stock price and trading volume activity in the Indonesia Stock Exchange. Research study of these events using the data interday using LQ45. The results showed differences in stock prices before and after the bombing Sarinah 2016. The study also showed no difference in trading volume activity before and after the bombing Sarinah, 2016.

Keywords: *event study, Sarinah bomb, interday, abnormal return.*



ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui apakah terdapat dampak peristiwa Bom Sarinah Januari 2016 terhadap return tidak normal, harga saham dan aktivitas volume perdagangan pada Bursa Efek Indonesia. Penelitian studi peristiwa ini menggunakan data *interday* dengan menggunakan LQ45. Hasil penelitian ini menunjukkan adanya perbedaan harga saham sebelum dan sesudah Bom Sarinah 2016. Penelitian ini juga menunjukkan tidak adanya perbedaan aktivitas volume perdagangan sebelum dan sesudah Bom Sarinah 2016.

Kata Kunci: studi peristiwa, bom sarinah, *interday*, return tidak normal.



DAFTAR ISI

	HAL
KATA PENGANTAR	v
ABSTRACT	vii
ABSTRAK	viii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Identifikasi Masalah	5
1.3 Tujuan Penelitian.....	6
1.4 Kegunaan Penelitian	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	
2.1 Kajian Pustaka	8
2.1.1 Pasar Modal	8
2.1.2 Investasi	14
2.1.3 Pengertian Saham dan Jenis-jenis Saham.....	17
2.1.4 Peristiwa Pasar Modal	22
2.1.5 Studi Peristiwa.....	23
2.2 Studi Pendahuluan	24

2.3	Rerangka Pemikiran	26
2.4	Model Penelitian.....	29
2.5	Pengembangan Hipotesis.....	29

BAB III OBJEK DAN METODE PENELITIAN

3.1	Jenis Penelitian	31
3.2	Definisi Operasional Variabel	31
3.3	Populasi dan Sampel.....	34
3.4	Teknik Pengumpulan Data	35
3.4.1	Ruang Lingkup Penelitian	35
3.4.2	Data.....	35
3.5	Metoda Analisis Data	36

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1	Pengujian Return Tidak Normal.....	43
4.2	Uji Beda Rarta-rata Harga Saham	46
4.2.1	Uji Normalitas Harga Saham.....	47
4.2.2	Perbedaan Rata-rata Harga Saham Tidak Norma.....	48
4.3	Uji Beda Rata-rata Aktivitas Volume Perdagangan	49
4.3.1	Uji Normalitas Aktivitas Volume Perdagangan	50
4.3.2	Uji Perbedaan Aktivitas Volume Perdagangan	51
4.4	Pembahasan Dampak Bom arinah 14 Januari 2016	52

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan.....54

5.2 Keterbatasan dan Saran.....55

DAFTAR PUSTAKA56



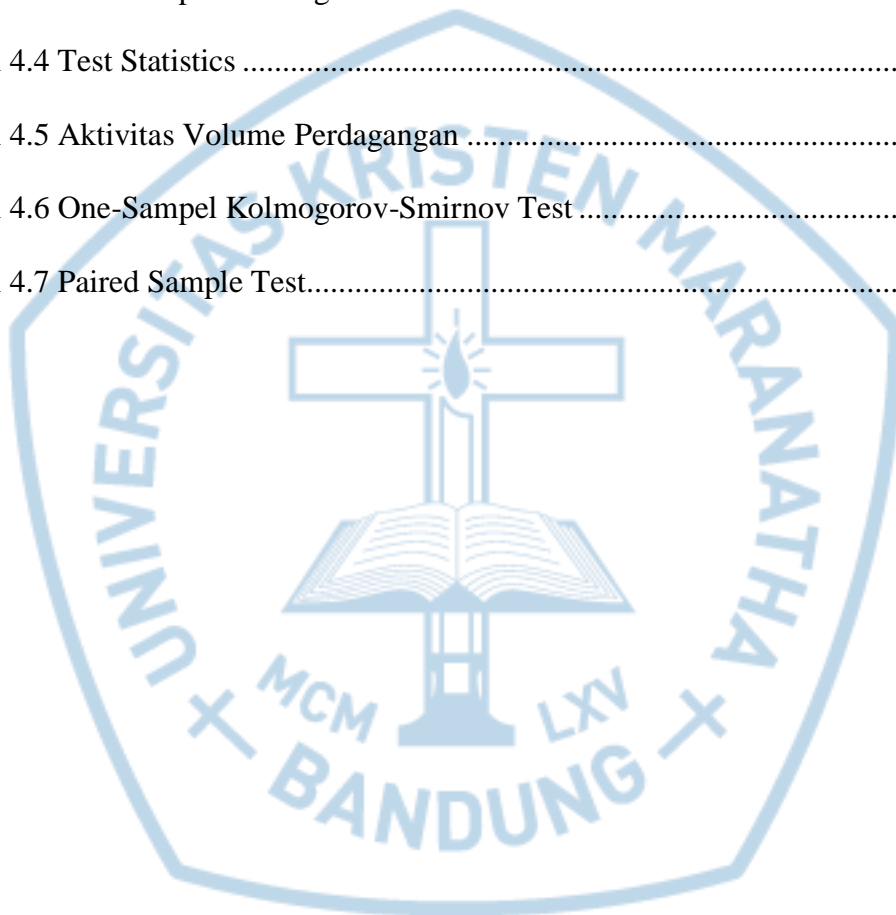
DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.2 Rerangka Pemikiran	28
Gambar 2.3 Model Penelitian	29



DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu	25
Tabel 3.1 Definisi Operasional Variabel.....	32
Tabel 4.1 Return Tidak Normal	44
Tabel 4.2 Rata-rata Return Tidak Normal.....	45
Tabel 4.3 One-Sampel Kolmogorov-Smirnov Test	47
Tabel 4.4 Test Statistics	48
Tabel 4.5 Aktivitas Volume Perdagangan	49
Tabel 4.6 One-Sampel Kolmogorov-Smirnov Test	51
Tabel 4.7 Paired Sample Test.....	52



DAFTAR LAMPIRAN

- Lampiran 1** **Peristiwa Bom Sarinah**
- Lampiran 2** **Daftar LQ45**
- Lampiran 3** **Data Mentah**
- Lampiran 4** **Perhitungan**
- Lampiran 5** **Output SPSS**

