

**ANALISIS PERBEDAAN RATA-RATA *ABNORMAL RETURN*
DAN RATA-RATA *TRADING VOLUME ACTIVITY*
BERDASARKAN *EVENT STUDY JANUARY*
EFFECT PADA INDEKS KOMPAS 100
PERIODE 2014-2015**

TUGAS AKHIR

Diajukan untuk memenuhi salah satu syarat menempuh sidang sarjana strata 1
(S-1)

Oleh

RAISYA TRIMELINDA

1352240



**JURUSAN MANAJEMEN FAKULTAS EKONOMI
UNIVERSITAS KRISTEN MARANATHA**

BANDUNG

2016

**ANALYZE OF DIFFERENCES AVERAGE ABNORMAL
RETURN AND AVERAGE TRADING VOLUME
ACTIVITY DEPENDS ON EVENT STUDY
JANUARY EFFECT IN KOMPAS 100
INDEX PERIOD 2014-2015**

A Thesis

**In Partial Fulfillment of The Requirements for The Degree of Bachelor of
Science in Management**

By

RAISYA TRIMELINDA

1352240



**MANAJEMENT DEPARTEMENT FACULTY OF
ECONOMICS MARANATHA
CHRISTIAN UNIVERSITY
BANDUNG
2016**

KATA PENGANTAR

Puji syukur penulis panjatkan kehadirat Allah S.W.T karena berkat rahmat dan karunia-Nya penulis dapat menyelesaikan penyusunan tugas akhir ini. Shalawat beserta salam beserta salam semoga senantiasa dilimpahkan kepada Nabi Muhammad S.A.W.

Penelitian yang berjudul Analisis Perbedaan Rata-Rata *Abnormal Return* dan Rata-Rata *Trading Volume Activity* Berdasarkan *Event Study January Effect* Pada Indeks Kompas 100 Periode 2014-2015, bertujuan untuk mengetahui apakah terjadi fenomena January Effect di Indonesia dengan menganalisis perbedaan rata-rata *abnormal return* dan *trading volume activity*.

Penulis menyadari bahwa tugas akhir ini masih jauh dari sempurna dan masih terdapat kekurangan.

Penulis mengucapkan terimakasih sebesar-besarnya kepada pihak-pihak yang telah membantu dalam penyusunan tugas akhir ini:

1. Kepada Ibu Dini Iskandar, S.E., M.M. selaku pembimbing penulis yang telah memberikan ilmu yang sangat bermanfaat dan dengan sabar membimbing penulis sehingga penulis dapat menyelesaikan tugas akhir ini.
2. Kepada orang tua penulis, mama dan papa yang senantiasa memberikan semangat doa, dan segala kebutuhan penulis sehingga penulis dapat terus bersemangat dalam menyelesaikan tugas akhir ini.
3. Kepada Bapak Dr. Drs. Mathius Tandiontong, S.E., M.M., Ak., CA. Selaku dekan fakultas ekonomi
4. Kepada Ibu Nonie Magdalena, S.E., M.Si. Selaku ketua jurusan Manajemen
5. Kepada bapak Surya Setiawan, S.E., M.Si. terimakasih untuk ilmu dan pelajaran yang telah diberikan kepada penulis.
6. Kepada kakak-kakak dan abang penulis yang terus memberikan masukan dan semangat kepada penulis dalam menyelesaikan skripsi ini.
7. Kepada ibu Herlina, S.E., M.T. selaku dosen wali penulis yang telah membimbing penulis dari awal perkuliahan hingga bisa menyelesaikan pendidikan sarjana ini.
8. Kepada seluruh jajaran dosen Universitas Kristen Maranatha Fakultas Ekonomi yang telah mengajarkan banyak pelajaran berharga kepada penulis.
9. Kepada semua staff Universitas Kristen Maranatha yang telah membantu penulis hingga saat ini.
10. Kepada teman-teman seperjuangan Diah, Gisela, Novia, Nuzul, Dini, Lady, Cindy, Chindy, Devina, Edlyn, Ezra, Gari, Syifa, Michelle, dan Gebi yang senantiasa hadir memberikan semangat kepada penulis untuk menyelesaikan tugas akhir ini.

11. Kepada teman-teman manajemen Universitas Kristen Maranatha angkatan 2013 yang telah banyak memberikan masukan, dan pelajaran berharga kepada penulis.
12. Kepada keponakan tercinta Kayana yang telah memberikan warna di hari-hari penulis, sehingga penulis tetap bersemangat dalam menyelesaikan tugas akhir ini.

Bandung, Januari 2017

Raisya Trimelinda