ANALISIS PERBEDAAN RATA-RATA ABNORMAL RETURN BERDASARKAN EVENT STUDY IDUL FITRI EFFECT PADA INDEKS LQ45 PERIODE 2015-2016

TUGAS AKHIR

Diajukan untuk memenuhi salah satu syarat menempuh Sidang Sarjana Strata 1 (S-1)

Oleh

Grace Kumala

1452214



JURUSAN MANAJEMEN FAKULTAS EKONOMI UNIVERSITAS KRISTEN MARANATHA BANDUNG 2017

ANALYZE OF DIFFERENCES AVERAGE ABNORMAL RETURN DEPENDS ON EVENT STUDY IDUL FITRI EFFECT IN LQ45 INDEX PERIOD 2015-2016

A Thesis

In Partial Fullfillment of the Requirements for The Degree of Bachelor of Science in Management

> By Grace Kumala 1452214



MANAGEMENT DEPARTEMENT FACULTY OF ECONOMICS MARANATHA CHRISTIAN UNIVERSITY BANDUNG 2017

KATA PENGANTAR

Puji syukur penulis panjatkan kepada Tuhan Yang Maha Esa karena berkat rahmat dan karunia-Nya penulis dapat menyelesaikan penyusunan tugas akhir ini. Penelitian yang berjudul "Analisis Perbedaan Rata-rata *Abnormal Return* Berdasarkan *Event Study* Idul Fitri *Effect* pada Indeks LQ45 Periode 2015 dan 2016", memiliki tujuan untuk menganalisis perbedaan rata-rata *abnormal return* sebelum dan sesudah Idul Fitri *Effect* pada Indeks LQ-45 periode 2015 dan 2016. Penulis melakukan perhitungan return saham dan *abnormal return* saham masingmasing perusahaan, selanjutnya penulis menganalisa tinggi rendahnya rata-rata *abnormal return* saham seminggu sebelum libur Idul Fitri dan seminggu sesudah libur Idul Fitri, kemudian membandingkan hasil kedua rata-rata *abnormal return* saham tersebut untuk mengetahui terdapat perbedaan atau tidak.

Penulis menyadari bahwa tugas akhir ini masih jauh dari sempurna dan masih terdapat kekurangan. Penelitian ini hanya berfokus terhadap variabel *abnormal return* saham pada perusahaan yang terdaftar di Indeks LQ45 selama periode pengamatan yaitu periode Agustus 2014 – Januari 2017.

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

- 1. Kepada Ibu Dini Iskandar, S.E., M.M selaku dosen pembimbing penulis yang telah membantu saya menyusun tugas akhir ini dengan sangat baik dan penuh sabar.
- 2. Kepada Orang Tua, yang telah memberikan saya dukungan agar dapat menyelesaikan tugas akhir ini dengan baik.
- 3. Kepada Bapak Dr. 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 Henky Lisan Suwarno, S.E., M.Si selaku dosen wali penulis yang telah membimbing penulis dari awal perkuliahan hingga dapat menyelesaikan pendidikan sarjana ini.
- 6. Kepada seluruh jajaran dosen Universitas Kristen Maranatha Fkultas Ekonomi yang telah mengajarkan banyak pelajaran berharga kepada penulis.
- 7. Kepada Jacklin Tandean, Teresa Adela dan Benardino selaku penulis , yang telah memberikan saya semangat dan selalu mengingatkan saya untuk menyelesaikan tugas akhir ini dengan baik.
- 8. Kepada Nathania C, Jeany C, Dhelby, Nidya dan Dennis S teman seperjuangan konsentrasi Manajemen Keuangan.
- 9. Kepada grup teman mamamz yang tidak dapat disebutkan satu per satu yang senantiasa selalu saling memberikan semangat satu sama lain.
- 10.Kepada teman- teman Manajemen Universitas Kristen Marantaha angkatan 2014 yang telah memberikan masukan dan pelajaran berharga bagi penulis.

11. Kepada grup Mobile Legend Squad yang telah memberikan penulis dukungan setiap harinya.