

**ANALISIS PENGARUH PERISTIWA TRAGEDI PARIS 13
NOVEMBER 2015 TERHADAP *ABNORMAL RETURN* DAN
LIKUIDITAS PADA SAHAM CAC40**

**MUHAMMAD ARIEFUDIN
8215112353**



**Skripsi Ini Disusun Sebagai Salah Satu Persyaratan Untuk Memperoleh
Gelar Sarjana Ekonomi Pada Fakultas Ekonomi Universitas Negeri Jakarta**

**PROGRAM STUDI S1 MANAJEMEN
KONSENTRASI MANAJEMEN KEUANGAN
FAKULTAS EKONOMI
UNIVERSITAS NEGERI JAKARTA
2016**

***THE EFFECT OF TRAGEDI PARIS 13 NOVEMBER 2015 ON
ABNORMAL RETURN AND LIQUIDITY ON CAC40 STOCKS***

**MUHAMMAD ARIEFUDIN
8215112353**



Skripsi is Written as Part Of Bachelor Degree in Economics Accomplishment

**STUDY PROGRAM OF S1 MANAGEMENT
MAJOR IN FINANCE MANAGEMENT
FACULTY OF ECONOMICS
STATE UNIVERSITY OF JAKARTA
2016**

ABSTRAK

Muhammad Ariefudin, 2016; Analisis Pengaruh Peristiwa Tragedi Paris 13 November 2015 Terhadap *Abnormal Return* Dan Likuiditas Pada Saham CAC40. Skripsi, Jakarta: Konsentrasi Manajemen Keuangan, Program Studi S1 Manajemen, Jurusan Manajemen, Fakultas Ekonomi, Universitas Negeri Jakarta

Penelitian ini bertujuan untuk menguji perbedaan *abnormal return* dan likuiditas yang diprosikan dengan *trading volume activity* antara sebelum dan sesudah peristiwa tragedi Paris yang terjadi pada tanggal 13 November 2015 pada saham CAC40. Sample yang digunakan dalam penelitian ini sebanyak 37 perusahaan dengan menggunakan teknik *purposive sampling*. Penelitian ini merupakan penelitian *event study* yang menggunakan metode *market adjusted model* dalam penentuan *expected return*. Pengujian perbedaan rata-rata *abnormal return* dan likuiditas di uji menggunakan metode *paired sample t-Test*. Dari hasil pengujian penelitian ini didapatkan bahwa tidak adanya perbedaan *abnormal return* dan *trading volume activity* antara sebelum dan setelah peristiwa tragedi Paris.

Kata kunci: *Event study*, *abnormal return*, likuiditas, *trading volume activity*, peristiwa terorisme

ABSTRACT

Muhammad Ariefudin, 2016; The Effect Of Tragedy Paris 13 November 2015 On Abnormal Return And Liquidity On CAC40 Stocks. Thesis, Jakarta: Concentration of Financial Management, Study Program of Management, Departement of Management, Faculty of Economics, State University of Jakarta.

The purpose of this study is to know The Effect Of Tragedy Paris 13 Noveber 2015 On Abnormal Return And Liquidity On CAC40 Stocks. The sample is from thirty seven companies and using purposive sampling. This is event study research using market adjusted model to calculated abnormal return. The empirical result shows that no differential abnormal return and liquidity between before and after tragedy Paris 2015.

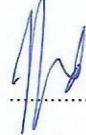




Keyword: Event Study, Abnormal Return, Liquidity, Trading Volume Activity, Terorism

LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI

Penanggung Jawab
Dekan Fakultas Ekonomi



Dr. Dedi Purwana, ES., M.Bus
NIP. 19671207 199203 1 001

Nama	Jabatan	Tanda Tangan	Tanggal
1. <u>Agung Wahyu Handaru, ST., MM</u> Nip. 19781127 200604 1 001	Ketua		25 Juli 2016
2. <u>Dra. Umi Mardiyati, M.Si</u> Nip. 19570221 198503 2 002	Sekretaris		25 Juli 2016
3. <u>Dr. Hamidah, SE., M.Si</u> Nip. 19560321 198603 2 001	Penguji Ahli		25 Juli 2016
4. <u>Dr. Suherman, SE., M.Si</u> Nip. 19731116 200604 1 001	Pembimbing I		25 Juli 2016
5. <u>Dr. Gatot Nazir Ahmad, S.Si., M.Si</u> Nip. 19720506 200604 1 002	Pembimbing II		25 Juli 2016

Tanggal Lulus : 21 Juli 2016.....

PERNYATAAN ORISINALITAS

Dengan ini saya menyatakan bahwa:

1. Skripsi ini merupakan karya asli dan belum pernah diajukan untuk mendapatkan gelar akademik sarjana, baik di Universitas Negeri Jakarta maupun di Perguruan Tinggi Lain.
2. Skripsi ini belum pernah dipublikasikan, kecuali secara tertulis dengan jelas dicantumkan sebagai acuan dalam naskah dengan disebutkan nama pengarang dan dicantumkan di dalam daftar pustaka.
3. Pernyataan ini saya buat dengan sesungguhnya, apabila di kemudian hari terdapat penyimpangan dan ketidakbenaran, maka saya bersedia menerima sanksi akademik berupa pencabutan gelar yang telah diperoleh, serta sanksi lainnya sesuai dengan norma yang berlaku di Universitas Negeri Jakarta.

Jakarta, 24 Juli 2016

Yang membuat pernyataan



Muhammad Ariefudin
8215112353