

DAFTAR ISI

ABSTRAK	ii
<i>ABSTRACT</i>	iii
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	iv
PERNYATAAN ORISINALITAS	v
DAFTAR ISI.....	vi
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Rumusan Masalah.....	6
C. Tujuan Penelitian	7
D. Manfaat Penelitian.....	7
BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN, DAN HIPOTESIS... 8	
A. Deskripsi Konseptual	8
1. Pengertian Pasar Modal.....	8
2. Pengertian Indeks CAC 40.....	9
3. <i>Event study</i>	10
4. Pasar Modal Efisien	11
5. <i>Return Saham</i>	13
6. <i>Expected Return</i>	15
7. <i>Abnormal return</i>	17
8. Likuiditas Saham.....	18
B. Review Penelitian Terdahulu.....	21
C. Kerangka Pemikiran Teoritis.....	30
D. Perumusan Hipotesis	32

BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....	34
A. Objek dan Ruang Lingkup Penelitian	34
1. Objek Penelitian	34
2. Ruang Lingkup Penelitian.....	34
B. Metode Penelitian	34
C. Operasionalisasi Variabel Penelitian	36
1. <i>Abnormal return</i>	36
2. <i>Trading volume activity (TVA)</i>	38
D. Metode Pengumpulan Data	39
E. Teknik Penentuan Populasi dan Sampel.....	40
1. Populasi	40
2. Sampel.....	40
F. Metode Analisis Data.....	41
1. Statistik Deskriptif.....	43
2. Uji Normalitas Data	44
3. Uji Hipotesis.....	44
a. <i>Paired Sample t-Test</i>	44
b. <i>Wilcoxon Signed Rank-Test</i>	45
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	46
A. Analisis Deskriptif.....	46
B. Hasil Penelitian dan Pembahasan	51
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	60
A. Kesimpulan.....	60
B. Saran	61
C. Implikasi Penelitian	61
DAFTAR PUSTAKA	63
LAMPIRAN-LAMPIRAN.....	65
RIWAYAT HIDUP	

KATA PENGANTAR

Puji syukur kepada Tuhan YME karena atas berkat dan karunia-Nya sehingga penulis dapat menyelesaikan skripsi yang berjudul “Analisis Pengaruh Peristiwa Tragedi Paris 13 November 2015 Terhadap *Abnormal Return* Dan Likuiditas Pada Saham CAC40.” dengan lancar. Oleh karena itu penulis mengucapkan terimakasih kepada:

1. Kedua orang tua tercinta, Bapak Burhanudin S.Sos dan Ibu Sarmani atas segala pengorbanan, bimbingan, dukungan serta doa selama ini.
2. Bapak Dr. Suherman, M.Si., selaku dosen pembimbing 1 sekaligus sebagai Pembimbing akademik atas bimbingan, nasihat, dan motivasinya mulai dari awal kuliah sampai penulis menyelesaikan skripsi ini.
3. Bapak Dr. Gatot Nazir Ahmad S.Si, M.Si., selaku dosen pembimbing 2 sekaligus sebagai Ketua Program Studi S1 atas bimbingan, nasihat, dan motivasinya mulai dari awal kuliah sampai penulis menyelesaikan skripsi ini.
4. Ibu Dr. Hamidah, M.Si., sebagai penguji ahli dalam sidang skripsi yang memberikan masukan dalam penyempurnaan skripsi ini.
5. Ibu Dra. Umi Mardiyati M.Si., sebagai sekretaris dalam sidang skripsi yang memberikan masukan dalam penyempurnaan skripsi ini.
6. Bapak Dr. Dedi Purwana, ES.,M.Bus., selaku Dekan Fakultas Ekonomi.
7. Seluruh dosen Jurusan Manajemen FE UNJ atas seluruh ilmu pengetahuan dan pengalaman selama penulis menempuh pendidikan di Jurusan Manajemen Fakultas Ekonomi Universitas Negeri Jakarta.

8. Teman-teman Manajemen Regular A 2011, teman-teman konsentrasi keuangan dan seluruh teman jurusan manajemen angkatan 2011 yang telah menjadi teman perjuangan selama kuliah ini.
9. Kakak dan Adik yang selalu menghibur dalam penulisan skripsi.
10. Riska Apriliani dan keluarga, yang selalu membantu, memberikan dukungan, motivasi, dan doa kepada penulis dalam menyusun skripsi ini.
11. Pihak-pihak yang tidak dapat disebutkan satu per satu yang telah membantu baik secara langsung maupun tidak langsung selama penulis menyelesaikan skripsi ini.

Dengan segala keterbatasan dalam skripsi ini, penulis berharap skripsi ini dapat memberikan manfaat dan inspirasi bagi penelitian berikutnya. Penulis dengan senang hati menerima kritik dan saran demi perbaikan tulisan ini di masa yang akan datang. Akhir kata penulis ucapkan terima kasih.

Jakarta, Juni 2016

Penulis

DAFTAR TABEL

Tabel	Judul	Halaman
2.1	Matriks Penelitian Terdahulu.....	28
3.1	Operasionalisasi Variabel.....	38
3.2	Jumlah Sample Penelitian	41
4.1	Analisis Deskriptif Perusahaan CAC40.....	46
4.2	Analisis Deskriptif Tanggal kejadian.....	48
4.3	Uji Normalitas Data.....	46
4.4	Uji Paired Sample T-Test Abnormal Return	54
4.5	Uji Paired Sample T-Test TVA.....	57

DAFTAR GAMBAR

Gambar	Judul	Halaman
2.1	Model Penelitian.....	32
3.1	Event Windows.....	35
4.1	Pergerakan Abnormal Return	50
4.2	Pergerakan Trading Volume Activity	51

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Daftar Sample Perusahaan

Lampiran 2 Data Abnormal Return Berdasarkan Perusahaan

Lampiran 3 Data Trading Volume Activity Berdasarkan Perusahaan

Lampiran 4 Data Abormal Return Trading Volume Activity Berdasarkan Event
Windows