

# LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI

Analisis Reaksi Investor Dalam Pasar Modal Terhadap Peristiwa Menguatnya Kurs Dollar Amerika Serikat (Event Study Pada Peristiwa Menguatnya Kurs Dollar Amerika Serikat Terhadap Nilai Tukar Rupiah Pada Tanggal 11 Oktober 2018)

Oleh  
**MOHAMAD SAFII**  
NIM. 931415145

Telah dipertahankan di depan Dewan Penguji

Hari/Tanggal : Kamis, 04 Juli 2019

Waktu : 13:00:00

### Penguji


1. Dr. HAI DAMA, SE, M.Si  
NIP.197303052002121003
2. DEWI INDRAYANI HAMIN, SE., MM  
NIP.198103122005012002
3. SELVI, SE, M.Si  
NIP.198005312009122004
4. LANTO MIRIATIN AMALI, S.Sos, M.Si  
NIP.198110222009122003

1.....  
2.....  
3.....  
4.....



Mengetahui:

Dekan **FAKULTAS EKONOMI**



Prof. Dr. Ir. SYARWANI CANON, M.Si  
NIP. 196507242000031001

**LEMBAR PERSETUJUAN PEMBIMBING**

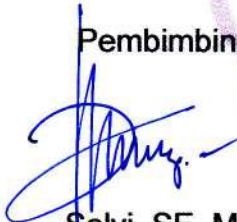
**SKRIPSI**

**ANALISIS REAKSI INVESTOR DALAM PASAR MODAL TERHADAP  
PERISTIWA MENGUATNYA KURS DOLAR AMERIKA SERIKAT  
( Event study pada peristiwa menguatnya kurs dolar AS terhadap  
nilai tukar rupiah tanggal 11 oktober 2018 )**

OLEH  
MOHAMAD SAFII  
NIM 931 415 145

Telah diperiksa dan disetujui untuk diuji

Pembimbing I



Selvi, SE, M.Si

NIP. 198005312009122004

Pembimbing II



Lanto Miriatin Amali, S.Sos, M.Si

NIP. 198110222009122003

Mengetahui:

Ketua Jurusan Manajemen



Dr. Hais Dama, SE, M.Si

NIP. 197303052002121003

**ANALISIS REAKSI INVESTOR DALAM PASAR MODAL TERHADAP  
PERISTIWA MENGUATNYA KURS DOLAR AMERIKA SERIKAT  
(Event Study Pada Peristiwa Menguatnya Kurs Dolar AS Terhadap Nilai  
Tukar Rupiah Tanggal 11 Oktober 2018)**

**Mohamad Safii**

**Selvi, SE, M.Si**

**Lanto Miriatin Amali, S.Sos, M.Si**

Fakultas Ekonomi

Universitas Negeri Gorontalo

**ABSTRAK**

**MOHAMAD SAFII. NIM: 931415145.** Analisis Reaksi Investor Dalam Pasar Modal Terhadap Peristiwa Menguatnya Kurs Dolar Amerika Serikat ( Event Study Pada Peristiwa Menguatnya Kurs Dolar AS Terhadap Nilai Tukar Rupiah Tanggal 11 Oktober 2018). S1 Manajemen, Jurusan Manajemen, Fakultas Ekonomi, Universitas Negeri Gorontalo, 2019. Di bawah bimbingan Selvi, SE, M.Si selaku Pembimbing I dan Lanto Miriatin Amali, S.Sos, M.Si selaku Pembimbing II.

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk membuktikan secara empiris perbedaan *abnormal return* dan aktivitas volume perdagangan saham sebelum dan sesudah peristiwa penguatan tertinggi kurs dolar AS terhadap nilai tukar rupiah. Penelitian ini merupakan penelitian kuantitatif dengan menggunakan data sekunder yang diperoleh dari laporan keuangan perusahaan. Populasi penelitian ini adalah perusahaan LQ-45 yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia pada tahun 2018 sebanyak 45 perusahaan. Teknik pengambilan sampel dalam penelitian ini menggunakan *purposive sampling* dengan kriteria perusahaan yang terdaftar dalam LQ45 periode Agustus 2018 sampai Januari 2019 dan peneliti dapat menemukan semua data yang diperlukan. Sampel yang memenuhi kriteria pada penelitian ini digunakan 13 perusahaan. Teknik analisis data yang digunakan adalah *paired sample t test* dengan menggunakan *software* SPSS versi 17.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa tidak terdapat perbedaan yang signifikan *abnormal return* dan aktivitas volume perdagangan saham sebelum dan sesudah peristiwa penguatan tertinggi kurs dolar AS terhadap nilai tukar rupiah.

**Kata Kunci** : *Abnormal Return*, Aktivitas Volume Perdagangan Saham, Kurs sDolar AS Terhadap Nilai Tukar Rupiah.

## ABSTRACT

**Mohamad Safii. NIM: 931415145.** Investor Reaction Analysis to the Capital Market on the Strengthening of the US Dollar (Study Event at the Strengthening Event of the US Dollar to the Rupiah on October 11, 2018). Bachelor Study Program of Management, Department of Management, Faculty of Economics, State University of Gorontalo, 2019. The principal supervisor is Selvi, SE, M.Si, and the co-supervisor is Lanto Miriatin Amali, S.Sos, M.Si.

This research aimed to prove empirically the difference between *abnormal return* and activity of stock trading volume before and after the highest strengthening of the US dollar exchange rate to the rupiah exchange rate. The research method used quantitative using secondary data obtained from the company's financial statements. The population was LQ-45 companies listed on the Indonesia Stock Exchange in 2018 amounted to 45 companies. The sampling technique used *purposive sampling* with the criteria of companies registered in LQ45 from August 2018 to January 2019, and the researcher found all the data needed. 13 samples of companies were qualified to the criteria used in this research. The data analysis technique used a *paired sample t-test* using SPSS software of 17 version.

The research findings indicated that there was no significant difference between *abnormal return* and stock trading volume activity before and after the highest strengthening of the US dollar exchange rate to the rupiah exchange rate.

**Keywords: Abnormal Return, Activity of Stock Trading Volume, US Dollar Exchange Rate to the Rupiah Exchange Rate.**

