

PENGARUH PENGUMUMAN *FEDERAL FUND RATE* DAN *BI RATE* TERHADAP *ABNORMAL RETURN* DAN *VOLUME PERDAGANGAN* DI PASAR SAHAM INDONESIA

NADHIRA AFINA PUTRI



**SEKOLAH PASCASARJANA
INSTITUT PERTANIAN BOGOR
BOGOR
2017**

© Hak Cipta Milik IPB

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencatunkan atau menyebutkan sumbernya. Pengujiannya hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik, atau tinjauan suatu masalah; dan pengutipan tersebut tidak merugikan kepentingan IPB. Dilarang mengumumkannya dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apa pun tanpa izin IPB.

PERNYATAAN MENGENAI TESIS DAN SUMBER INFORMASI SERTA PELIMPAHAN HAK CIPTA*

Dengan ini saya menyatakan bahwa tesis berjudul Pengaruh Pengumuman *Federal Fund Rate* dan *BI Rate* terhadap *Abnormal Return* dan Volume Perdagangan di Pasar Saham Indonesia adalah benar karya saya dengan arahan dari komisi pembimbing dan belum diajukan dalam bentuk apa pun kepada perguruan tinggi mana pun. Sumber informasi yang berasal atau dikutip dari karya yang diterbitkan maupun tidak diterbitkan dari penulis lain telah disebutkan dalam teks dan dicantumkan dalam Daftar Pustaka di bagian akhir tesis ini.

Dengan ini saya melimpahkan hak cipta dari karya tulis saya kepada Institut Pertanian Bogor.

Bogor, November 2017

Nadhira Afina Putri
NIM P056163751.55



*Pelimpahan hak cipta atas karya tulis dari penelitian kerjasama dengan pihak luar IPB harus didasarkan pada perjanjian kerjasama yang terkait.



© Hak Cipta Milik IPB, Tahun 2017

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan atau menyebutkan sumbernya. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik, atau tinjauan suatu masalah; dan pengutipan tersebut tidak merugikan kepentingan IPB

Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apa pun tanpa izin IPB

© Hak Cipta Milik IPB

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan atau menyebutkan sumbernya. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik, atau tinjauan suatu masalah; dan pengutipan tersebut tidak merugikan kepentingan IPB. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apa pun tanpa izin IPB

PENGARUH PENGUMUMAN *FEDERAL FUND RATE* DAN *BI RATE* TERHADAP *ABNORMAL RETURN* DAN *VOLUME PERDAGANGAN* DI PASAR SAHAM INDONESIA

NADHIRA AFINA PUTRI

Tesis
sebagai salah satu syarat untuk memperoleh gelar
Magister Manajemen
pada
Program Studi Manajemen dan Bisnis



**SEKOLAH PASCASARJANA
INSTITUT PERTANIAN BOGOR
BOGOR
2017**

© Hak Cipta Milik IPB

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencatunkan atau menyebutkan sumbernya. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik, atau tinjauan suatu masalah; dan pengutipan tersebut tidak merugikan kepentingan IPB. Dilarang mengumunkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apa pun tanpa izin IPB.



Penguji Luar Komisi pada Ujian Tesis: Prof Dr Ir Bambang Juanda, MS



© Hak Cipta Milik IPB

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencatunkan atau menyebutkan sumbernya. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik, atau tinjauan suatu masalah; dan pengutipan tersebut tidak merugikan kepentingan IPB. Dilarang mengumunkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apa pun tanpa izin IPB

Judul Tesis : Pengaruh Pengumuman *Federal Fund Rate* dan *BI Rate* terhadap *Abnormal Return* dan Volume Perdagangan di Pasar Saham Indonesia
Nama : Nadhira Afina Putri
NIM : P056163751.55

Disetujui oleh
Komisi Pembimbing

Dr Lukytawati Anggraeni, SP, MSi
Ketua

Dr Syamsul Hidayat Pasaribu SE, MSi
Anggota

Diketahui oleh

Ketua Program Studi
Manajemen dan Bisnis

Plt. Dekan Sekolah Pascasarjana

Prof Dr Ir M. Syamsul Maarif, MEng

Dr Ir Eka Intan Kumala Putri, MSi



Tanggal Ujian: 25 Oktober 2017

Tanggal Lulus:

PRAKATA

Puji dan syukur penulis panjatkan kepada Allah *subhanahu wa ta'ala* atas segala karunia-Nya sehingga penelitian ini dapat diselesaikan. Tema yang dipilih dalam penelitian ini adalah mengenai kebijakan moneter terhadap *abnormal return* pasar saham di Indonesia. Adapun judul penelitian ini adalah “Pengaruh Pengumuman *Federal Fund rate* dan *BI Rate* terhadap *Abnormal Return* dan Volume Perdagangan di Pasar Saham Indonesia”. Penelitian ini dilakukan dari bulan Januari 2017 sampai dengan Oktober 2017 untuk memenuhi salah satu persyaratan dalam memperoleh gelar Magister Manajemen pada program studi Manajemen Bisnis di Sekolah Bisnis Institut Pertanian Bogor. Selama proses penyelesaian penelitian ini penulis memperoleh bimbingan, arahan, serta bantuan dari berbagai pihak.

Dengan demikian penulis ingin menyampaikan ucapan terima kasih kepada Dr Lukytawati Anggraeni SP, MSi sebagai Pembimbing I, Dr Syamsul Hidayat Pasaribu SE, MSi sebagai Pembimbing II. Ungkapan terimakasih juga disampaikan kepada papa, mama, eyang, serta saudara-saudara (M Rizqi Prabowo dan M Irfan Prabowo), teman satu bimbingan, dan teman-teman kelas R55 dan R56 atas segala doa serta kasih sayangnya.

Keterbatasan penulis dari segi ilmu dan pengalaman, menyebabkan tesis ini memiliki banyak kekurangan. Penulis berharap semoga tesis ini dapat bermanfaat.

Bogor, Oktober 2017

Nadhira Afina Putri

