

“REAKSI INVESTOR DI PASAR MODAL INDONESIA TERHADAP PERISTIWA MELEMAHNYA NILAI TUKAR RUPIAH TERHADAP DOLAR AMERIKA SERIKAT (EVENT STUDY PADA PERUSAHAAN SEKTOR INDUSTRI DASAR DAN KIMIA YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK INDONESIA”

Oleh :
Ni Luh Winda Rini, NIM 1517051191
Jurusan Ekonomi dan Akuntansi
Universitas Pendidikan Ganesha
Singaraja, Indonesia
2019

Abstrak

Penelitian ini bertujuan mengetahui perbedaan rata-rata *abnormal return*, *trading volume activity* dan *security return variability* sebelum dan setelah peristiwa melemahnya nilai tukar rupiah terhadap dolar Amerika Serikat pada 11 Oktober 2018 pada sektor industri dasar dan kimia. Jenis data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data sekunder dengan teknik pengumpulan data menggunakan metode *browsing* dan dokumentasi. Penentuan sampel dalam penelitian ini menggunakan metode *purposive sampling* dengan kriteria-kriteria tertentu sehingga memperoleh 45 sampel. Teknik analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah *wilxocon signed ranks* dengan periode pengamatan selama 10 hari. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa: (1) Terdapat perbedaan rata-rata *abnormal return* sebelum dan setelah peristiwa (2) Tidak terdapat perbedaan rata-rata *trading volume activity* sebelum dan setelah peristiwa (3) Tidak terdapat perbedaan rata-rata *security return variability* sebelum dan setelah peristiwa melemahnya nilai tukar rupiah terhadap dolar Amerika Serikat pada 11 Oktober 2018.

Kata kunci: *Abnormal Return, Security Return Variability, Trading Volume.*

**"THE INVESTOR REACTION IN CAPITAL MARKET TOWARD THE
EVENT OF THE WEAKENING OF RUPIAH EXCHANGE RATE
AGAINSTS UNITED STATES DOLLAR
(EVENT STUDY IN COMPANY'S BASIC AND CHEMICAL SECTORS IN
INDONESIA STOCK EXCHANGE)"**

By :
Ni Luh Winda Rini, NIM 1517051191
Jurusan Ekonomi dan Akuntansi
Universitas Pendidikan Ganesha
Singaraja, Indonesia
2019

Abstract

The study aimed at determining the effect of human resources quality variable in the field of accounting, organizational commitment, and profitability individually and collectively on the punctuality of financial reporting. The method of data collection applied a survey with a questionnaire instrument measured through a Likert scale. The population of this research was all Savings and Loans Cooperatives and Multipurpose Cooperatives in Jembrana District, with 60 respondents. The data were processed through multiple linear regression analysis test through SPSS version 24.0 for windows. The results of this study indicated that the quality of human resources, organizational commitment and profitability had partially a positive and significant effect on the punctuality of financial reporting at the Cooperatives in Jembrana District. This was because the positive regression coefficient and the significant value of the t test were smaller than α , besides that it was found that the dominant variable was Organizational Commitment

Keywords: Abnormal Return, Security Return Variability, Trading Volume.