

ABSTRAK

Rizki Nuraini. NPM.16610142, Pengaruh Pemilihan Presiden Indonesia Terhadap Abnormal Return dan Trading Volume Activity (Event Study pada Saham IDX30 yang Terdaftar di BEI). Prodi Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Muhammadiyah Metro. Pembimbing (I) Dr. Afdal Mazni, S.E., M.M. Pembimbing (II) Sri Retnaning Rahayu, S.E., M.M.

Kata Kunci : Pemilihan Presiden Indonesia Tahun 2019, *Abnormal Return*, *Trading Volume Activity*.

Penelitian ini merupakan studi peristiwa yang bertujuan untuk mengetahui perbedaan rata-rata *abnormal return* dan *trading volume activity* pada waktu sebelum dan setelah pemilihan presiden Indonesia tahun 2019. Jenis Penelitian merupakan Penelitian Kuantitatif dengan populasi penelitian 30 perusahaan yang terdaftar di dalam anggota indeks IDX30, hanya 26 sampel yang digunakan yang sesuai dengan kriteria yang telah ditentukan. Data yang digunakan adalah data sekunder berupa harga saham harian, volume perdagangan harian, dan jumlah saham yang diperdagangkan selama periode jendela. Uji statistik yang digunakan untuk menguji hipotesis adalah uji *paired sample t-test* dan di uji menggunakan program SPSS versi 20.

Berdasarkan hasil uji statistik menunjukkan bahwa tidak terdapat perbedaan rata-rata *abnormal return* yang signifikan setelah peristiwa pemilihan presiden Indonesia, sedangkan untuk rata-rata *trading volume activity* menunjukkan terdapat perbedaan rata-rata trading volume activity yang signifikan setelah pemilihan presiden Indonesia.