

ABSTRAK

Pariani, NIM 7113220032, Pengaruh Pemilihan Presiden RI Tahun 2014 Terhadap Abnormal Return dan Volume Perdagangan Di Bursa Efek Indonesia (Study Kasus pada Kelompok Saham LQ-45). Skripsi, Program Studi Akuntansi, Fakultas Ekonomi, Universitas Negeri Medan, 2015.

Permasalahan dalam penelitian ini adalah apakah Peristiwa Pemilihan Presiden berpengaruh terhadap *Abnormal Return* dan Volume Perdagangan di Bursa Efek Indonesia. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui apakah ada perbedaan *Abnormal Return* dan Volume Perdagangan sebelum dan sesudah Pemilu Presiden 2014.

Populasi dalam penelitian ini adalah perusahaan yang termasuk dalam Indeks LQ-45 tahun 2014. Sumber data dalam penelitian ini adalah data sekunder yang diperoleh dari situs resmi www.idx.co.id, SahamOk dan *YahooFinance*. Pengujian hipotesis ini dilakukan dengan bantuan SPSS 20.

Hasil penelitian yang diperoleh dengan taraf signifikan $\alpha = 5\%$ menunjukkan bahwa terdapat perbedaan secara signifikan sebelum dan sesudah Peristiwa Pemilihan Presiden RI tahun 2014. Hal ini menunjukkan bahwa peristiwa pemilihan presiden menimbulkan reaksi pasar dan digunakan oleh investor sebagai dasar pengambilan keputusan untuk membeli atau menjual saham.

Kata kunci : Teori Pasar Efisien, Studi Peristiwa, Abnormal Return, Volume Perdagangan

ABSTRACT

Pariani, NIM 7113220032 The Efek 2014 Presidential Election Against Abnormal Return and Trading Volume in the Indonesia Stock Exchange (Stock Group Case Study on the LQ-45). Thesis, Accounting Major, Faculty of Economy, State University of Medan, 2015.

Problems in this study is whether the effect on the Presidential Election Event Abnormal Return and Trading Volume in the Indonesia Stock Exchange. This study aims to determine whether there are differences Abnormal Return and Volume of Trade before and after the 2014 Presidential Election.

The population in this study is a company that is included in the LQ-45 in 2014. The source of data in this research is secondary data obtained from the official website www.idx.co.id, SahamOk and yahoofinance. Hypothesis testing is performed with SPSS 20.

The results obtained with significance level $\alpha = 5\%$ indicates that there is a significant difference before and after the Presidential election events in 2014. This suggests that the events of the presidential election raises the market reaction and is used by investors as a basis for a decision to buy or sell shares .

Keywords: *Efficient Market Theory, Event Study, Abnormal Return, Trading Volume Activit.*

THE
Character Building
UNIVERSITY