

ABSTRAK

Anita Desti Kartika Sari, 1950510022, Reaksi Kinerja Saham Terhadap Peristiwa Konferensi Tingkat Tinggi G20 di Bali (*Event Study* Pada Bursa Efek Indonesia, Korea Selatan, Jepang, dan India)

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui reaksi kinerja saham terhadap peristiwa Konferensi Tingkat Tinggi G20 di Bali. Jenis penelitian ini adalah studi peristiwa (*event study*) dengan pendekatan kuantitatif, dan objek penelitian yang digunakan yaitu perusahaan yang bergerak di sektor energi yang terdaftar di indeks IHSG (Indonesia), KOSPI (Korea Selatan), Nikkei 225 (Jepang), dan BSE Sensex (India) dengan memperoleh sampel berjumlah 96 perusahaan. Metode pengumpulan data dalam penelitian ini dari data sekunder yaitu harga saham perusahaan yang berasal dari *website investing.com* dan www.idx.co.id dengan *purposive sampling*. Teknik analisis data pada penelitian ini menggunakan uji *paired sample t-test* dengan program SPSS 22. Hasil penelitian menyatakan bahwa pada Bursa Efek Indonesia, Korea Selatan, Jepang, dan India tidak terdapat perbedaan *abnormal return* sebelum dan sesudah peristiwa Konferensi Tingkat Tinggi G20 di Bali. Nilai signifikansi yang dihasilkan Indonesia adalah 0,596, Korea Selatan nilai signifikansinya yaitu 0,835, untuk Jepang menghasilkan nilai signifikansi 0,700, sedangkan India nilai signifikansinya 0,271. Sehingga pada pembagian antara negara maju dan berkembang menunjukkan hasil bahwa negara maju (Bursa Efek Korea Selatan dan Jepang) tidak terdapat perbedaan *abnormal return* sebelum dan sesudah peristiwa, dan negara berkembang (Bursa Efek Indonesia dan India) juga tidak terdapat perbedaan *abnormal return* sebelum dan sesudah KTT G20 di Bali.

Kata Kunci: *Abnormal Return, Event Study, KTT G20 di Bali*