

ABSTRAK

“Dampak Kondisi Politik dalam Negeri (Pengumuman Resmi KPU Tentang Rekapitulasi Pilpres, Pelantikan Presiden dan Wakil Presiden, dan Pengumuman Susunan Kabinet) Tahun 2019 Terhadap *Abnormal Return* saham Perusahaan yang Tergabung dalam LQ45.”

Tujuan dalam penelitian ini adalah untuk menganalisis perbedaan *abnormal return* selama 10 hari sebelum dan 10 hari sesudah peristiwa politik dalam negeri (pengumuman resmi KPU tentang rekapitulasi pilpres, pelantikan residen dan wakil presiden dan pengumuman susunan kabinet) pada tahun 2019 pada emiten yang tergabung dalam indeks LQ45

Metode yang digunakan dalam penelitian ini adalah *event study* dimana dilakukan pengamatan 10 hari sebelum peristiwa dan 10 hari sesudah peristiwa. Data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data sekunder yang diperoleh melalui website resmi IDX dan *yahoo finance*, data yang diambil adalah harga penutupan harian saham emiten yang masuk dalam sampel penelitian dan harga penutupan harian IHSG. Sampel yang digunakan dalam penelitian ini berjumlah 37 perusahaan. Alat analisis yang digunakan adalah uji beda dua sampel berpasangan (*paired sampel t-test*) dan *wilcoxon signed range test* menggunakan SPSS 16.0.

Berdasarkan hasil analisis menunjukkan pengujian *abnormal return* menghasilkan kesimpulan bahwa; (1) Tidak ada perbedaan *abnormal return* 10 hari sebelum dan 10 hari sesudah peristiwa pengumuman resmi KPU tentang rekapitulasi pilpres tahun 2019 pada emiten yang tergabung dalam indeks LQ45. (2) Tidak ada perbedaan *abnormal return* 10 hari sebelum dan 10 hari sesudah peristiwa pelantikan presiden dan wakil presiden tahun 2019 pada emiten yang tergabung dalam indeks LQ45. (3) Tidak ada perbedaan *abnormal return* 10 hari sebelum dan 10 hari sesudah peristiwa pengumuman susunan kabinet pada tahun 2019 pada emiten yang tergabung dalam indeks LQ45.

Kata Kunci : *Event Study*, Peristiwa Politik dalam Negeri, *Abnormal Return*