Abstract

The purpose of this research is to know wheter there is impact of politic event i.e. general election and president inauguration in 2014 to abnormal return, stock price and trading volume activity in Indonesia Stock Exchange. This event study research uses interday data which listed in LQ45. It shows there are differences in stock price between before and after this politic event. However, there are no differences in trading volume activity.

Keywords*: event study, politic event, interday, abnormal return.*

Abstrak

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui apakah terdapat dampak peristiwa politik Pemilu dan pelantikan Presiden 2014 terhadap return tidak normal, harga saham dan aktivitas volume perdagangan pada Bursa Efek Indonesia. Penelitian studi peristiwa ini menggunakan data *interday* dengan menggunakan LQ45. Hasil penelitian ini menunjukan adanya perbedaan harga saham setelah dan sebelum Pemilu 2014, tetapi tidak menunjukkan adanya perbedaan harga saham setelah dan sebelum pelantikan Presiden. Penelitian ini juga menemukan tidak adanya perbedaan aktivitas volume perdagangan setelah dan sebelum peristiwa Pemilu dan pelantikan Presiden 2014.

Kata-kata kunci: studi peristiwa, peristiwa politik, *interday*, return tidak normal.

DAFTAR ISI

DAFTAR TABEL

DAFTAR GAMBAR

DAFTAR LAMPIRAN