

## ABSTRAK

### REAKSI PASAR MODAL TERHADAP PERISTIWA PENGUMUMAN PENYEBARAN PANDEMI VIRUS CORONA DI INDONESIA

(Studi Empiris Pada Perusahaan Indeks LQ45 Di Bursa Efek Indonesia)

Oleh

YUDHA RAMA PRAKASA

Penelitian ini merupakan studi peristiwa yang bertujuan untuk menguji secara empiris kandungan informasi terhadap peristiwa sosial pengumuman penyebaran pandemi virus corona dengan pemberlakuannya Pembatasan Sosial Berskala Besar (PSBB) di Indonesia. Reaksi pasar modal dapat dilihat menggunakan indikator perbedaan rata-rata *abnormal return* dan *trading volume activity* sebelum dan setelah peristiwa. Populasi penelitian ini adalah perusahaan anggota indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia, *purposive sampling* adalah metode yang digunakan dalam pengambilan sampel pada penelitian ini dengan jumlah sampel sebanyak 42 perusahaan. Periode pengamatan dilakukan masing-masing empat hari pada periode sebelum dan setelah peristiwa. Pengujian dilakukan dengan metode uji beda parametrik *paired sample t-test* dan uji non parametrix *Wilcoxon signed rank test*. Hasil dalam penelitian ini menyatakan bahwa terdapat perbedaan signifikan *abnormal return* antara sebelum dan setelah peristiwa pengumuman penyebaran pandemi virus corona dengan pemberlakuannya Pembatasan Sosial Berskala Besar (PSBB) di Indonesia. terdapat perbedaan signifikan *Trading volume activity* antara sebelum dan setelah peristiwa pengumuman penyebaran pandemi virus corona dengan pemberlakuannya Pembatasan Sosial Berskala Besar (PSBB) di Indonesia.

**Kata Kunci :** Pembatasan Sosial Berskala Besar (PSBB), Studi Peristiwa, Abnormal Return, Trading Volume Activity