UIN SUSKA RIAU
Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang
1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.
b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar UIN Suska Riau.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin UIN Suska Riau.
© Hak cipta milik UIN Suska Riau
State Islamic University of Sultan Syarif Kasim Riau

ABSTRAK

DAMPAK PILKADA DKI JAKARTA 2017 TERHADAP PASAR MODAL INDONESIA PADA INDEKS LQ 45 DI BURSA EFEK INDONESIA

OLEH:

TATAG IVANTO PURWANDANI
11371104771

LQ45 merupakan salah satu Indeks yang ada di Bursa Efek Indonesia (BEI). Indeks LQ45 terdiri dari 45 perusahaan yang memiliki likuiditas tinggi, yang diseleksi melalui beberapa kriteria pemilihan. Dengan menggunakan saham yang terdaftar di LQ45, maka akan diketahui seberapa berpengaruh peristiwa *pemilihan gubernur* DKI Jakarta putaran II terhadap pergerakan harga saham pada perusahaan yang terdaftar di LQ45. Tujuan penelitian ini untuk menguji dan menganalisis perbedaan rata-rata *abnormal return* sebelum dan sesudah peristiwa *reshuffle* kabinet pada Indeks LQ45. Penelitian ini dilakukan di Bursa Efek Indonesia yaitu dengan mengamati pergerakan harga saham pada perusahaan *go public* (saham yang tercatat dalam bursa saham) perusahaan tersebut terdaftar pada Indeks LQ45. Waktu penelitian dilakukan pada tanggal 10 februari 2017 sampai mei 2017. Berdasarkan data kualifikasi di atas maka sampel yang diambil dalam penelitian ini adalah sebanyak 44 perusahaan. Kesimpulan dari penelitian ini adalah tidak terdapatnya perbedaan yang signifikan rata-rata *abnormal return* sebelum peristiwa *pilkada DKI jakarta 2017* dengan rata-rata *abnormal return* sesudah peristiwa *pilkada DKI jakarta 2017*. bahwa rata-rata sebelum *pilkada DKI jakarta 2017* adalah bernilai -0,0019, sedangkan rata-rata sesudah *pilkada DKI jakarta 2017* adalah -0,0012, jadi rata-rata *abnormal return* sedikit mengalami kenaikan sesudah *pilkada DKI jakarta 2017* dibandingkan dengan sebelum *pilkada DKI jakarta 2017*. Tetapi perubahan tersebut tidak terlalu signifikan sehingga tidak memberikan hasil yang kuat bahwa peristiwa tersebut mempengaruhi pergerakan *Average Abnormal Return* sebelum dan sesudah peristiwa.

Kata kunci: Pilkada Jakarta 2017, pasar modal Indonesia, Indeks LQ45.