

LAPORAN SKRIPSI

**Pengaruh Pengumuman *Suspect Corona* di Indonesia terhadap
Abnormal Return dan Volume Perdagangan Saham pada Perusahaan
Sektor Farmasi, Transportasi dan Logistik yang *Go Public*
di Bursa Efek Indonesia.**



VANIA ARDELIA WIDJANARKO

17.D1.0136

PROGRAM STUDI MANAJEMEN

FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS

UNIVERSITAS KATOLIK SOEGIJAPRANATA

SEMARANG

2024

LAPORAN SKRIPSI

Pengaruh Pengumuman *Suspect Corona* di Indonesia terhadap *Abnormal Return* dan Volume Perdagangan Saham pada Perusahaan Sektor Farmasi, Transportasi dan Logistik yang *Go Public* di Bursa Efek Indonesia.

Diajukan Kepada Program Studi Manajemen
Universitas Katolik Soegijapranata Semarang untuk Memenuhi
Sebagian dari Syarat-syarat Guna Memperoleh
Gelar Sarjana Manajemen



Oleh:

VANIA ARDELIA WIDJANARKO

17.D1.0136

PROGRAM STUDI MANAJEMEN

FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS

UNIVERSITAS KATOLIK SOEGIJAPRANATA

SEMARANG

2024

ABSTRAK

Kondisi pasar modal sangat dipengaruhi oleh peristiwa-peristiwa yang terjadi di lingkungan sekitarnya. Salah satu peristiwa yang memengaruhi kondisi pasar modal adalah pengumuman Covid-19 sebagai pandemi oleh WHO. Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui apakah terdapat perbedaan yang signifikan Trading Volume Activity dan abnormal return pada perusahaan sektor farmasi, transportasi dan logistik yang go publik di bursa efek Indonesia sebelum dan sesudah pengumuman Covid-19 oleh pemerintah Indonesia. Penelitian ini merupakan penelitian kuantitatif berupa event study dengan periode pengamatan selama 15 hari yang terdiri dari 7 hari sebelum peristiwa, hari peristiwa, dan 7 hari setelah peristiwa. Penelitian ini menggunakan data sekunder yang diperoleh dari website resmi Bursa Efek Indonesia dan yahoo finance. Hasil penelitian menunjukkan bahwa tidak ditemukan perbedaan yang signifikan pada Abnormal Return maupun Trading Volume Activity sebelum dan sesudah peristiwa pengumuman Covid-19.

ABSTRACT

Capital market conditions are greatly influenced by events occurring in the surrounding environment. One of the events that influenced capital market conditions was the announcement of Covid-19 as a pandemic by WHO. The aim of this research is to find out whether there is a significant difference in Trading Volume Activity and abnormal returns in pharmaceutical, transportation and logistics sector companies that went public on the Indonesian stock exchange before and after the announcement of Covid-19 by the Indonesian government. This research is quantitative research in the form of an event study with an observation period of 15 days consisting of 7 days before the event, the day of the event, and 7 days after the event. This research uses secondary data obtained from the official website of the Indonesian Stock Exchange and Yahoo Finance. The research results showed that there were no significant differences in Abnormal Return or Trading Volume Activity before and after the Covid-19 announcement.

Keywords: Event Study, Abnormal Return, Trading Volume Activity, Covid-19 Announcement