

LAPORAN SKRIPSI

PENGARUH PEMILIHAN PRESIDEN DAN WAKIL PRESIDEN

TERHADAP ABNORMAL RETURN DAN TRADING VOLUME

ACTIVITY SAHAM DI JAKARTA ISLAMIC INDEX



Hendrika Thessalonika Fiorella Polly

21.D1.0137

PROGRAM STUDI MANAJEMEN

FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS

UNIVERSITAS KATOLIK UNIKA SOEGIJAPRANATA

SEMARANG

TAHUN 2024/2025.

ABSTRAK.

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh peristiwa Pemilihan Presiden dan Wakil Presiden tahun 2024 terhadap abnormal return dan trading volume activity saham yang tergabung dalam Jakarta Islamic Index (JII). Penelitian ini menggunakan metode event study dengan periode pengamatan selama 10 hari, yaitu lima hari sebelum dan lima hari setelah tanggal 14 Februari 2024. Sampel yang digunakan adalah 30 saham syariah yang tergabung dalam JII dan terpilih berdasarkan kriteria likuiditas yang ditetapkan oleh Bursa Efek Indonesia. Hasil penelitian menunjukkan bahwa tidak terdapat perbedaan yang signifikan pada rata-rata abnormal return sebelum dan sesudah peristiwa pemilihan dan tidak terdapat perbedaan signifikan pada rata-rata trading volume activity. Temuan ini menunjukkan bahwa pasar saham syariah tidak merespons secara signifikan terhadap perubahan harga dan perubahan dalam volume perdagangan sebagai bentuk reaksi terhadap peristiwa politik tersebut.

Kata kunci: Abnormal Return, Trading Volume Activity, Pemilihan Presiden, Event Study, Jakarta Islamic Index