

DAMPAK SEBELUM DAN SESUDAH TERJADINYA COVID-19 TERHADAP ABNORMAL RETURN DAN AKTIVITAS VOLUME PERDAGANGAN SAHAM KELOMPOK PERUSAHAAN LQ45 DI BEI

Intan Zoraya*¹
Vika Fitranita²
Indah Oktari Wijayanti²

¹Manajemen, Fakultas Ekonomi dan Bisnis, Universitas Bengkulu, Indonesia

²Akuntansi, Fakultas Ekonomi dan Bisnis, Universitas Bengkulu, Indonesia

Abstrak

Penelitian ini menjelaskan dampak sebelum dan sesudah terjadinya covid-19 terhadap abnormal return dan aktivitas volume perdagangan saham Di BEI. Populasi dalam penelitian ini adalah seluruh perusahaan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia selama Januari 2020 sampai dengan Juni 2020. Berdasarkan hasil olah data hipotesis pertama diterima yaitu terdapat perbedaan rata-rata abnormal return yang diperoleh para investor sebelum dan setelah peristiwa covid-19 pada LQ 45. Hipotesis kedua pada olah data penelitian ini terdapat perbedaan rata-rata aktivitas volume perdagangan saham sebelum dan setelah peristiwa covid-19. Berdasarkan hasil penelitian, hal ini menunjukkan bahwa investor mengalami kepanikan dan kekhawatiran akan rugi yang diakibatkan adanya Covid-19 dan memacu para investor untuk menjual sahamnya

Kata Kunci: Covid-19; Abnormal Return; Trading Volume of Shares

Abstract

This study examines the impact before and after the occurrence of covid-19 on abnormal returns and stock trading volume activities on the IDX. The population in this study were all companies listed on the Indonesia Stock Exchange during January 2020 to June 2020. Based on the results of the data processing, the first hypothesis was accepted, namely that there were differences in the average abnormal returns obtained by investors before and after the Covid-19 incident at LQ 45. The second hypothesis in the data processing of this research is that there is a difference in the average stock trading volume activity before and after the Covid-19 event. Based on the results of the study, this shows that investors experience panic and fears of loss caused by Covid-19 and spur investors to sell their shares.

Keyword: Covid-19; Abnormal Return; Trading Volume of Shares

Article History: Received: (30-09-2021); Revised: (20-10-2021); and Published: (30-11-2021)

Copyright © 2021 Intan Zoraya, Vika Fitranita, Indah Oktari Wijayanti

How to cite this article: Zoraya, I., Fitranita, V., Wijayanti, I, O. (2021). Dampak Sebelum dan Sesudah Terjadinya Covid-19 terhadap Abnormal Return dan Aktivitas Volume Perdagangan Saham di BEI (Uji Kasus pada Saham yang Terdaftar dalam Kelompok Perusahaan LQ 45). *Managament Insight: Jurnal Ilmiah Manajemen*. 16(2), 211-226

Retrieved from: <https://ejournal.unib.ac.id/index.php/Insight>