

Analisis pengaruh peristiwa pemilihan umum tahun 2014 terhadap abnormal return indeks saham sektoral di bursa efek Indonesia =
Analysis of the election event effect in 2014 to the abnormal return of sectoral stock index in indonesia stock exchange

Rakhmat Adi Sampurno, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20404164&lokasi=lokal>

Abstrak

Tesis ini membahas pengaruh peristiwa politik dalam negeri terhadap abnormal return indeks-indeks sektoral di BEI pada tahun 2014. Peristiwa politik yang diambil adalah quick count pemilihan legislatif, real count pemilihan legislatif, quick count pemilihan presiden, dan real count pemilihan presiden.

Penelitian ini bertujuan ingin melihat bagaimana reaksi sektor-sektor saham akibat peristiwa politik tersebut. Metode yang digunakan adalah dengan event study dan pengujian hipotesis dengan menggunakan Wilcoxon Sign Rank test.

Hasil yang didapatkan menunjukkan bahwa tidak semua sektor saham bereaksi signifikan pada saat event window. Perbedaan abnormal return antara sebelum dan sesudah peristiwa hanya ditemukan pada sektor agriculture disaat peristiwa real count pileg dan mining disaat peristiwa realcount pilpres sedangkan di sektor lainnya tidak terdapat perbedaan abnormal return yang signifikan.