

**PERBEDAAN ABNORMAL RETURN DAN VOLUME PERDAGANGAN
SAHAM PADA PERUSAHAAN SUBSEKTOR TELEKOMUNIKASI
YANG TERDAFTAR DI BEI SEBELUM DAN SESUDAH
PENGUMUMAN IMBAUAN WORK FROM HOME TANGGAL 15
MARET 2020**

Oleh:

Dian Elsa Novita

17061049

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui apakah terdapat perbedaan *abnormal return* dan volume perdagangan saham pada perusahaan subsektor telekomunikasi yang terdaftar di BEI sebelum dan sesudah pengumuman imbauan *work from home* tanggal 15 Maret 2020. Periode pengamatan dilakukan selama 7 hari sebelum dan 7 hari sesudah pengumuman imbauan *work from home* tanggal 15 Maret 2020. Jenis penelitian ini adalah studi peristiwa. Penentuan sampel menggunakan teknik sampling jenuh, dengan jumlah sampel sebanyak 6 perusahaan yang terdaftar pada subsektor telekomunikasi di Bursa Efek Indonesia. Data dalam penelitian ini merupakan data sekunder. Teknik analisis data yang digunakan adalah uji beda dengan *wilcoxon signed ranks test*. Hasil dari penelitian ini menunjukkan tidak adanya perbedaan *abnormal return* dan volume perdagangan saham pada perusahaan subsektor telekomunikasi yang terdaftar di BEI sebelum dan sesudah pengumuman imbauan *work from home* tanggal 15 Maret 2020.

Kata Kunci: *Abnormal Return*, Volume Perdagangan Saham, *Event Study*.

***THE DIFFERENCE OF ABNORMAL RETURN AND TRADING VOLUME
ACTIVITY AT TELECOMMUNICATION SUBSECTOR COMPANY LISTED
AT IDX BEFORE AND AFTER THE ANNOUNCEMENT OF WORK FROM
HOME APPEAL ON MARCH 15, 2020***

By:

Dian Elsa Novita

17061049

ABSTRACT

This study aims to determine whether there are differences in abnormal return and trading volume activity in telecommunication subsector company listed at IDX before and after the announcement of work from home appeal on March 15, 2020. The observation period was carried out for 7 days before and 7 days after the announcement of work from home appeal on March 15, 2020. This type of research is an event study. Determination of the sample using saturated sampling technique, with a total sample of 6 companies in telecommunication subsector listed at Indonesia Stock Exchange. The data in this study are secondary data. The data analysis technique used is a different test with the Wilcoxon signed ranks test. The results of this study indicate that there is no difference in abnormal returns and trading volume activity in telecommunication subsector company listed at IDX before and after the announcement of work from home appeal on March 15, 2020.

Keywords: Abnormal Return, Trading Volume Activity, Event Study