

**PENGARUH PENGUMUMAN PERANG DAGANG AMERIKA SERIKAT -  
TIONGKOK TERHADAP *ABNORMAL RETURN* DAN  
*TRADING VOLUME ACTIVITY* PADA INDEKS  
LQ45 DI BURSA EFEK INDONESIA**

**Oleh:**

**Muhammad Aditya T.M (141150543)**

**[muh.aditya.tm@gmail.com](mailto:muh.aditya.tm@gmail.com)**

**ABSTRAKSI**

Penelitian ini bertujuan untuk menguji dan menganalisis reaksi investor terhadap peristiwa pengumuman perang dagang antara Amerika Serikat dengan Republik Rakyat Tiongkok pada 08 Maret 2018 lalu. Reaksi investor diukur dengan menggunakan *abnormal return* dan *trading volume activity* saham. Penelitian ini merupakan penelitian *event study* dengan teknik pengambilan sampel menggunakan *purposive sampling*. Sumber data dalam penelitian ini adalah data sekunder. Metode analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah uji *one sample t-test* untuk menghitung terjadinya *abnormal return* di sekitar peristiwa, serta *paired sample t-test* untuk membandingkan perbedaan nilai rata-rata *abnormal return* dan *trading volume activity* saham antara sebelum dan sesudah peristiwa. Berdasarkan hasil penelitian ini, terdapat *abnormal return* di sekitar peristiwa pengumuman perang dagang, tidak terdapat perbedaan signifikan antara rata-rata *abnormal return* saham sebelum dan sesudah peristiwa pengumuman perang dagang, serta tidak terdapat perbedaan signifikan antara rata-rata *trading volume activity* saham sebelum dan sesudah peristiwa pengumuman perang dagang.

**Kata Kunci:** *abnormal return, trading volume activity*