

**ANALISIS DAMPAK PERGANTIAN MENTERI KEUANGAN REPUBLIK
INDONESIA TERHADAP *ABNORMAL RETURN* DAN *TRADING*
VOLUME ACTIVITY PERUSAHAAN IDX30 BURSA EFEK INDONESIA**

M Raihan Triandika
NIM. 141210188

Mahasiswa Program Studi Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis

Universitas Pembangunan “Veteran” Yogyakarta

raihantriandikaa@gmail.com

ABSTRAK

Penelitian ini merupakan penelitian *event study* yang bertujuan untuk menganalisis pengaruh dari peristiwa pergantian Menteri Keuangan Republik Indonesia terhadap *abnormal return* dan *trading volume activity* pada Bursa Efek Indonesia. Data yang digunakan dalam penelitian ini adalah jenis data sekunder yaitu data *return* saham IHSG dan aktivitas volume pedagangannya yang diambil dari Bursa Efek Indonesia. Metode penelitian yang digunakan untuk menguji data adalah dengan *Wilcoxon Signed Rank Test* karena data *abnormal return* dan *trading volume activity* ditemukan berdistribusi dengan tidak normal. Hasil penelitian menunjukkan nilai *Asymp. Sig. (2-tailed)* $0.116 > 0.05$ yang berarti terdapat perbedaan secara signifikan *abnormal return* sebelum dan setelah pergantian Menteri Keuangan Republik Indonesia. Nilai *Asymp. Sig. (2-tailed)* untuk TVA sebesar $0.096 > 0.05$ yang berarti terdapat perbedaan signifikan TVA sebelum dan setelah peristiwa pergantian Menteri Keuangan Republik Indonesia.

Kata Kunci: *Abnormal Return, Trading Volume Activity, Event Study, Wilcoxon Signed Rank Test, Bursa Efek Indonesia*