

INTISARI

Penelitian ini berfungsi untuk menganalisis bagaimana peristiwa Peresmian Danantara terhadap pergerakan IHSG di Bursa Efek Indonesia. Penelitian ini merupakan penelitian kuantitatif dengan pendekatan event study, dengan periode jendela 29 hari (14 hari sebelum dan 14 hari setelah peristiwa). Penelitian ini menggunakan data sekunder yang diperoleh dari website resmi Bursa Efek Indonesia. Sampel yang digunakan adalah 15 saham-saham BUMN selama periode jendela. Teknik pengambilan sampel dilakukan dengan metode purposive sampling untuk memastikan kesesuaian data dengan kriteria penelitian. Alat analisis yang digunakan ialah uji normalitas dan uji hipotesis di SPSS dengan menggunakan data perhitungan abnormal return dan return. Hasil penelitian menunjukkan bahwa tidak terdapat perbedaan pergerakan saham-saham BUMN, pergerakan IHSG, dan Pergerakan Indeks LQ45 yang signifikan terhadap peristiwa Peresmian Danantara.

Kata kunci : Peresmian Danantara, *IHSG*, *LQ45*, Rata Rata *Abnormal Return*

ABSTRACT

This study aims to analyze the impact of the Danantara Inauguration event on the movement of the Jakarta Composite Index (JCI) on the Indonesia Stock Exchange. It employs a quantitative approach using an event study methodology, with a 29-day observation window (14 days before and 14 days after the event). The study utilizes secondary data obtained from the official website of the Indonesia Stock Exchange. The sample consists of 15 state-owned enterprise (BUMN) stocks, the JCI, and the LQ45 Index during the event window. The sampling technique used is purposive sampling to ensure that the selected data meet the research criteria. Data analysis includes normality tests and hypothesis testing conducted in SPSS, based on return and abnormal return calculations. The findings indicate that there is no significant difference in average abnormal return, JCI movement, or LQ45 Index movement in relation to the Danantara Inauguration event.

Keywords : *Inauguration of Danantara, JCI, LQ45, AAR*