

## ABSTRAK

### **ANALISIS ABNORMAL RETURN PADA SAHAM YANG MASUK DAN KELUAR DARI INDEX LQ45 SELAMA PERIODE 2010-2019**

**Samuel Edgar**

**19/452806/PEK/45758**

Penelitian ini bertujuan untuk meneliti *abnormal return* yang terjadi pada peristiwa pengumuman anggota indeks LQ45. Metode yang digunakan adalah *event study* untuk membuktikan adanya *abnormal return*, dan regresi menggunakan variabel volume, ROE, dan PER untuk menjelaskan *abnormal return* yang terjadi. Sampel penelitian dipilih dengan metode *purposive sampling*, sehingga data yang digunakan adalah saham perusahaan yang masuk dan keluar dari indeks LQ45 selama periode 2010 hingga 2019. Hasil penelitian menunjukkan bahwa terdapat AAR yang signifikan di sekitar tanggal pengumuman, dan CAR yang signifikan untuk saham perusahaan yang masuk LQ45.

**Kata Kunci : *abnormal return, event study, LQ45, AAR, CAR, ROE, PER.***