

ABSTRAKSI

REAKSI PASAR TERHADAP KUNJUNGAN BARACK OBAMA KE INDONESIA

(Dibawah bimbingan Ibu Anastasia Sri Mendari,S.E.,M.M.)

Penelitian ini membahas mengenai reaksi pasar terhadap kunjungan Barack Obama ke Indonesia yang terjadi pada tanggal 9 dan 10 November 2010. Pengambilan sampel dilakukan dengan *purposive sampling* dan diperoleh 42 perusahaan yang dijadikan sampel. Tujuan dari penelitian ini adalah untuk membuktikan adanya reaksi pasar yang terjadi di sekitar peristiwa kunjungan Barack Obama ke Indonesia. Pengujian pada penelitian ini diawali dengan menghitung *abnormal return* dan *trading volume activity* di sekitar peristiwa atau periode pengamatan yaitu 12 hari yang terdiri dari 6 hari sebelum dan 6 hari sesudah peristiwa. Kemudian dilakukan pengujian normalitas data untuk mengetahui apakah data yang digunakan berdistribusi normal atau tidak. Langkah selanjutnya adalah mengolah data yang telah berdistribusi normal dengan metode analisis *one sampel t-test* dan *paired sampel t-test*. Hasil penelitian ini pada pengujian *one sampel t-test* pada *abnormal return* dan *trading volume activity* (TVA) menunjukkan bahwa pasar bereaksi terhadap peristiwa kunjungan Barack Obama ke Indonesia dan hasil dari pengujian *Paired Sample T-Test* pada *abnormal return* dan *trading volume activity* (TVA) menunjukkan bahwa tidak adanya perbedaan secara signifikan sebelum dan sesudah terjadinya peristiwa kunjungan Barack Obama ke Indonesia.

Kata kunci: Reaksi pasar, *Abnormal Return*, dan *Trading Volume Activity*