

## **ABSTRAK**

### **ANALISIS EVENT STUDY TERKAIT DENGAN PEMBAGIAN SAHAM BONUS DAN PENGARUHNYA TERHADAP *ABNORMAL RETURN* DAN VOLUME PERDAGANGAN SAHAM PADA PERUSAHAAN PERBANKAN DAN LEMBAGA KEUANGAN DI BEI**

Oleh

**RENDY PRANATHA**

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh pembagian saham bonus Terhadap *abnormal return* dan volume perdagangan saham pada perusahaan perbankan dan lembaga keuangan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Dalam penelitian ini saham bonus merupakan salah satu bentuk *corporate action* yang dilakukan sebagai salah satu cara untuk meningkatkan nilai perusahaan. Penelitian ini menggunakan metode kuantitatif, data yang di gunakan adalah data sekunder yang didapat dari Bursa Efek Indonesia. Populasi penelitian ini adalah sebanyak 5 perusahaan perbankan dan lembaga keuangan yang melakukan pembagian Saham Bonus pada periode 2011-2013. Dari tehknik pengambilan sampel dengan menggunakan *Purposive Sampling*.

Data yang di butuhkan dalam penelitian ini adalah data harian selama 30 hari pengamatan. Pengujian terhadap hipotesis penelitian digunakan uji-t menggunakan *Paired Samples T-Test*. Hasil penelitian menunjukkan bahwa hipotesa pertama *abnormal return* periode sebelum dan sesudah pengumuman Saham Bonus tidak ada perbedaan yang signifikan, oleh karena itu hipotesis pertama tidak teruji kebenarannya. Hipotesa kedua dari penelitian ini juga menunjukkan bahwa volume perdagangan saham periode sebelum dan sesudah pengumuman Saham Bonus juga tidak ada perbedaan yang signifikan, oleh karena itu hipotesis kedua juga tidak teruji kebenarannya.

Kata kunci : saham bonus, volume perdagangan saham, dan *abnormal return*