

ABSTRAK

Nama : Egry Dwiyana Tambunan
Program Studi : Manajemen
Judul : Pengaruh Idul Fitri Terhadap *Abnormal Return* Saham LQ45
Tahun 2019-2021 di Bursa Efek Indonesia

Penelitian ini dilakukan dengan tujuan untuk mengetahui bagaimana pengaruh Idul Fitri terhadap *abnormal return* saham LQ45 tahun 2019-2021 di Bursa Efek Indonesia. Data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data sekunder yang diperoleh dari *website* investing.com yang berbentuk laporan historis harga saham masing-masing perusahaan yang dijadikan sebagai sampel dalam penelitian ini. Sampel yang digunakan dalam penelitian ini adalah sebanyak 45 perusahaan yang terdaftar di LQ45 sampai dengan tahun 2023, di mana teknik analisis data yang digunakan adalah uji perbandingan dengan menggunakan uji *independent sample t-test* menggunakan bantuan perangkat lunak SPSS versi 26. Hasil penelitian menunjukkan bahwa tidak terdapat perbedaan yang signifikan antara *abnormal return* saham sebelum dan sesudah hari libur Idul Fitri. Akan tetapi, *abnormal return* saham sebelum hari libur Idul Fitri sedikit lebih baik daripada *abnormal return* saham sesudah hari libur Idul Fitri pada perusahaan yang terdaftar di LQ45 periode 2019-2021. Sehingga dapat disimpulkan bahwa hari libur Idul Fitri tidak memberikan dampak terhadap perubahan harga maupun *return* saham pada perusahaan yang terdaftar di LQ45 selama periode 2019-2021.

Kata Kunci : *Abnormal Return* Saham, *Return* Saham, Hari Libur Idul Fitri, dan Uji *Independent Sample T-test*.

ABSTRACT

Name : Egry Dwiyana Tambunan
Study Program : Management
Title : The Effect of Eid Al-Fitr on The Abnormal Return of LQ45 Shares
In 2019-2021 on The Indonesia Stock Exchange

This study was conducted with the aim of determining how Eid al-Fitr affects the abnormal return of LQ45 shares in 2019-2021 on the Indonesia Stock Exchange. The data used in this study is secondary data obtained from the investing.com website in the form of historical reports on the stock prices of each company used as a sample in this study. The samples used in this study are as many as 45 companies registered in LQ45 until 2023, where the data analysis technique used is a comparison test using an independent sample t-test using the help of SPSS software version 26. The results showed that there was no significant difference between abnormal stock returns before and after the Eid al-Fitr holiday. However, abnormal stock returns before Eid al-Fitr holidays are slightly better than abnormal stock returns after Eid al-Fitr holidays in companies listed in LQ45 for the 2019-2021 period. So it can be concluded that the Eid al-Fitr holiday does not have an impact on price changes or stock returns in companies listed on LQ45 during the 2019-2021 period.

Keywords : *Abnormal Stock Return, Stock Return, Eid Mubarak Holiday, and Independent Sample T-Test*