

## ABSTRAK

**Yulia Rahmadini** : **Evaluasi Dampak COVID-19 Terhadap *Abnormal Return* dan *Trading Volume Activity* Saham *Socially Responsible* dan Saham Terlikuid yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia**  
**2017/17059071**  
**Pembimbing** : **Aimatul Yumna, SE.M.Fin, Ph.D**

Pandemi COVID-19 mengguncang iklim investasi di pasar modal Indonesia, sehingga berdampak pada keputusan investor dalam memilih saham-saham tangguh dimasa pandemi. Saham yang bertanggung jawab secara sosial dianggap lebih andal saat krisis dibandingkan dengan saham lainnya. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui perbedaan *Abnormal Return* dan *Trading Volume Activity* sebelum dan sesudah pengumuman COVID-19 sebagai pandemi global oleh *World Health Organization* pada 11 Maret 2020 terhadap indeks SRI-Kehati dan LQ45. Pemilihan sampel menggunakan teknik *purposive sampling* dengan sampel 17 perusahaan SRI-Kehati dan 21 perusahaan LQ45. Analisis data yang digunakan adalah *one sample t-test*, *paired sample t-test*, *wilcoxon signed rank test*, *independent sample t-test* dan *mann-whitney u*. Hasil penelitian menunjukkan bahwa terdapat *abnormal return* yang signifikan dan perbedaan yang signifikan pada *average abnormal return* kedua indeks tersebut. Terdapat perbedaan signifikan *average trading volume activity* SRI-Kehati kecuali LQ45. Tidak terdapat perbedaan signifikan antara *average abnormal return* dan *average trading volume activity* SRI-Kehati dengan *average abnormal return* dan *average trading volume activity* LQ45. Jadi hasil penelitian menunjukkan bahwa saham SRI-Kehati lebih diminati investor di masa pandemi.

**Kata kunci** : ***Abnormal return*, *trading volume activity*, SRI-Kehati, LQ45, COVID-19 pandemi global**