

DAMPAK BERITA KORUPSI PEJABAT BUMN
DARI TAHUN 2010-2020 TERHADAP *ABNORMAL RETURN*

Nabila Ramadhani
Manajemen/Keuangan, Investasi,
dan Intermediasi Keuangan
Putu Anom Mahadwartha
Endang Ernawati

ABSTRAK

Tujuan penelitian ini adalah untuk menguji dampak berita korupsi Pejabat BUMN terhadap *abnormal return*. Penelitian ini menggunakan metode event study dengan variabel AR, CAR, dan BUMN publik sebagai objek penelitian. Hasil dari penelitian ini adalah, terdapat perbedaan *abnormal return* negatif signifikan pada pair tertentu. Perbedaan *abnormal return* negatif signifikan juga terdapat pada CAR kecuali pada satu hari sebelum *event* dan 1 hari setelah *event*.

Kata Kunci: Korupsi, *Event Study*, *Abnormal Return*

*THE IMPACT OF CORRUPTION NEWS
OF INDONESIA STATE OWNED ENTERPRISE OFFICIALS
ON ABNORMAL RETURNS*

Nabila Ramadhani
Manajemen/Keuangan, Investasi,
dan Intermediasi Keuangan
Putu Anom Mahadwartha
Endang Ernawati

ABSTRACT

The purpose of this study is to examine the impact of corruption news of Indonesia State Owned Enterprise Officials on abnormal return. This study uses the event study research method with AR, CAR as variabls and public SOEs as research objects. The results of this study are, there are significant negative abnormal returns differences in certain pairs. There are also a significant negative abnormal return difference in CAR except one day before the event and one day after the event.

Keywords: Corruption, Event Study, Abnormal Return

