

ABSTRAK

Penelitian ini merupakan penelitian studi peristiwa (*event study*) yang bertujuan untuk mengetahui apakah terdapat pengaruh pada pasar modal Indonesia khususnya saham pada sektor pertambangan terhadap peristiwa global yakni pengumuman pengesahan presiden Amerika Serikat tahun 2021. Indikator yang dipakai pada penelitian ini adalah *abnormal return*, *trading volume activity*, dan frekuensi perdagangan saham. Populasi dalam penelitian ini adalah saham pada sektor pertambangan dan data yang digunakan diantaranya data Indeks Harga Saham Gabungan, harga saham penutupan harian, saham yang diperdagangkan, saham yang beredar, dan frekuensi transaksi saham perusahaan tambang. Penelitian memakai periode jendela selama 7 hari sebelum dan 7 hari sesudah peristiwa. Hasil uji menemukan bahwa variabel *abnormal return* tidak terdapat perbedaan reaksi terhadap peristiwa. Sedangkan untuk variabel *trading volume activity* dan variabel frekuensi perdagangan saham ditemukan terdapat perbedaan reaksi terhadap peristiwa pengumuman pengesahan presiden Amerika Serikat Tahun 2021.

Kata Kunci : *event study*, *abnormal return*, *trading volume activity*, frekuensi perdagangan saham.

