



**JURUSAN AKUNTANSI
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS
UNIVERSITAS ANDALAS**



SKRIPSI

**“ANALISIS REAKSI *CRYPTOCURRENCY* DAN PASAR SAHAM INDONESIA
SERTA PASAR SAHAM LUAR NEGERI TERHADAP KANDUNGAN INFORMASI
PERISTIWA *BLOCKCHAIN LIFE 2021*”**

(Studi Peristiwa pada *Cryptocurrencies Market Cap 1-50 Ranking*,
Indeks LQ45 dan Indeks DJIA)

Oleh:

FATHON OKTAVIAN SOSYL

1810531022

Dosen Pembimbing:

Rayna Kartika, SE., Ak., M.Comm

Diajukan untuk Memenuhi Sebagian dari Syarat-syarat Guna Memperoleh Gelar Sarjana

Akuntansi

PADANG

2022

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menguji dan menganalisis pengaruh *event Blockchain Life 2021* dengan mengukur *abnormal return* dan *trading volume activity* terhadap *cryptocurrency* dan pasar saham indonesia serta luar negeri. Penelitian ini menggunakan *windows period* dengan rentan waktu 10 hari sebelum dan 10 hari sesudah *event Blockchain Life 2021*. Populasi dalam penelitian ini adalah *cryptocurrency market cap 1-50 ranking*, Indeks LQ45 dan Indeks DJIA. Sampel dalam penelitian ini berjumlah 115 sampel yaitu terdiri dari 40 koin dan 75 perusahaan. Jenis penelitian ini merupakan penelitian kuantitatif dan diperoleh dari data sekunder. Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwa tidak ada reaksi *abnormal return* dan *trading volume activity* pada *cryptocurrency* terhadap *event Blockchain Life 2021*, dan tidak ada reaksi *abnormal return* tetapi terdapat reaksi *trading volume activity* pada bursa saham indeks LQ45 terhadap *event Blockchain Life 2021*, serta tidak ada reaksi *abnormal return* dan *trading volume activity* pada bursa saham indeks DJIA terhadap *event Blockchain Life 2021*.

Kata Kunci: *Blockchain Life 2021; cryptocurrency; pasar saham; abnormal return; trading volume activity*

