

INTISARI

Penelitian ini dilakukan untuk mengetahui adanya *abnormal return* serta perbedaan *abnormal return* dan aktivitas volume perdagangan disepulur tanggal pengumuman *right issue*. Sampel yang diambil yaitu perusahaan yang melakukan *right issue* dan terdaftar sebagai anggota di Bursa Efek Jakarta selama periode tahun 2001-2004.

Metode yang dilakukan dalam penelitian ini menggunakan alat analisis uji beda *one sample t-test* dan *paired sample t-test*. Hasil penelitian menunjukkan tidak terdapat *abnormal return* secara umum, dan tidak terdapat perbedaan *abnormal return* serta aktivitas volume perdagangan secara signifikan disepulur tanggal pengumuman *right issue*.

ABSTRACT

This research do to know there is any *abnormal return* and difference of *abnormal return* and trade volume activity around the announcement date of *right issue*. The sample was take from company that do *right issue* and registered as member in Jakarta Stock Exchange as long as 2001-2004.

The method that do in this research use analysis device of different test *one sample t-test* and *paired sample t-test*. The result of research indicate there is nothing any *abnormal return* and trade volume activity on a significant around the announcement date of *right issue*.

Keyword: *Abnormal return, right issue, trade volume activity.*