

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk memperoleh bukti dan mengamati pengaruh praktik Moral Hazard, yang telah dilakukan Melinda Dee sebagai pejabat di Citibank dan juga yang dilakukan oleh Kepala Cabang Bank Mega, terhadap pergerakan harga saham dan volume perdagangan perbankan nasional yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia.

Penelitian ini menggunakan sampel harga saham dari 31 bank yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia selama kasus Citibank dan Bank Mega terjadi. Alat analisis menggunakan program Ms. Excel dan *event study* untuk dapat mengamati pergerakan dan reaksi dari harga saham melalui perhitungan *abnormal return* dan perbedaan yang signifikan dari rata – rata abnormal return antara sebelum dan sesudah kasus terjadi. Dalam pengumpulan datanya, penelitian ini menganalisis data sekunder yang diperoleh di *stock summary* dari Bursa Efek Indonesia.

Hasil penelitian menyatakan bahwa, kasus Melinda Dee dan Bank Mega tidak berpengaruh terhadap pergerakan harga saham dan volume perdagangan perbankan nasional. Pergerakan harga saham dan volume penjualan perbankan tidak menunjukkan adanya pengaruh dari kedua kasus tersebut.

Penelitian ini hanya mengamati pengaruh kasus Melinda Dee dan Bank Mega dari pergerakan harga saham dan volume penjualan perbankan nasional. Untuk penelitian yang akan datang, jika terdapat cara untuk melihat dampak dari suatu kasus perbankan lebih dalam harus dimasukkan untuk mendapatkan hasil yang lebih baik

Kata kunci : harga saham, volume perdagangan saham, perbankan, *abnormal return*