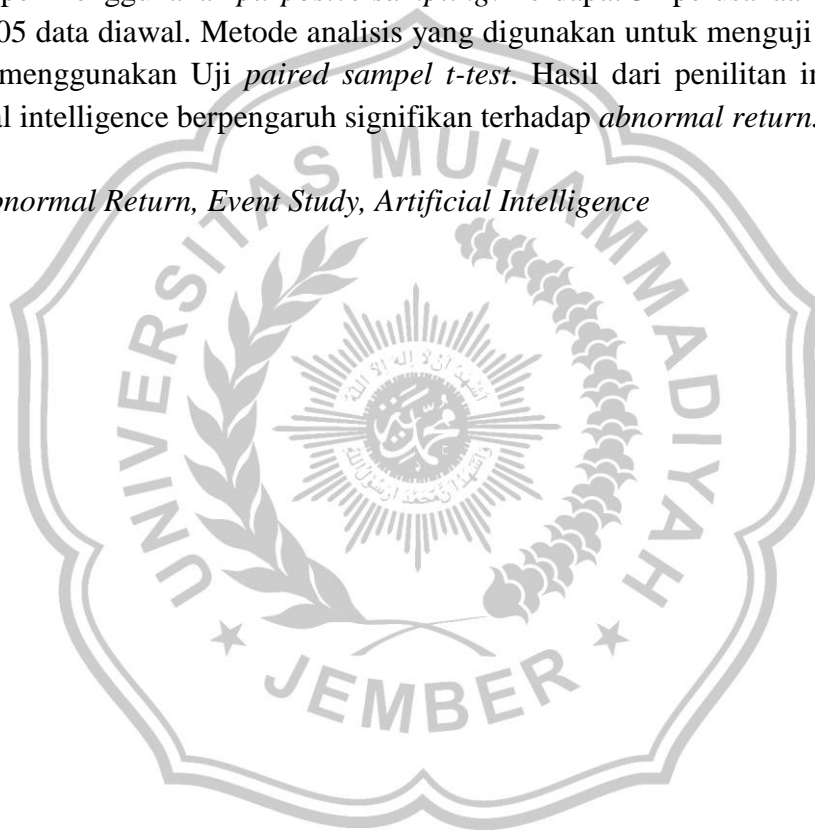


ABSTRAK

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui adanya *abnormal return* saat sebelum dan sesudah pengembangan *artificial intelligence* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Penelitian ini menggunakan studi peristiwa (*event study*) yang mempelajari reaksi pasar terhadap suatu peristiwa. Studi peristiwa digunakan untuk menguji kandungan informasi dari suatu pengumuman. Populasi yang digunakan dalam penelitian ini adalah perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 5 hari sebelum dan 5 hari sesudah di tahun 2021-2024. Data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data sekunder dan pemilihan sampel menggunakan *purposive sampling*. Terdapat 32 perusahaan sebagai sampel dengan total 105 data di awal. Metode analisis yang digunakan untuk menguji hipotesis dalam penelitian ini menggunakan Uji *paired sampel t-test*. Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwa *artificial intelligence* berpengaruh signifikan terhadap *abnormal return*.

Kata kunci: *Abnormal Return, Event Study, Artificial Intelligence*



ABSTACT

The purpose of this study was to determine any abnormal returns before and after the development of artificial intelligence which was listed on the Indonesian Stock Exchange. This research uses an event study which studies market reactions to an event. Event studies are used to test the information content of an announcement. The population used in this research is banking companies listed on the Indonesia Stock Exchange for the period 5 days before and 5 days after 2021-2024. The data used in this research is secondary data and sample selection used purposive sampling. There were 32 companies as samples with a total of 105 initial data. The analytical method used to test the hypothesis in this research uses the paired sample t-test. The results of this research show that artificial intelligence has a significant effect on abnormal returns.

Keywords: Abnormal Return, Event Study, Artificial Intelligence

