

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN MOTTO DAN PERSEMBAHAN	iii
HALAMAN PERNYATAAN	iv
KATA PENGANTAR	v
UCAPAN TERIMAKASIH	vi
DAFTAR ISI	vii
ABSTRAK	x
INTISARI	xiv
BAB I. PENDAHULUAN	
1.1.Latar Belakang Masalah.....	1
1.2.Rumusan Masalah	5
1.3.Tujuan Penelitian	5
1.4.Manfaat Penelitian	6
Bab II. KAJIAN PUSTAKA	
2.1.Pasar Modal	8
2.1.1.Return Saham.....	12
2.1.2.Abnormal Return.....	14
2.1.3.Trading Volume Activity	17
2.2.Pengaruh Kenaikan Harga BBM Terhadap Harga Saham Pertambangan	19
2.3.Pengaruh Perubahan Harga BBM Terhadap Volume Aktivitas Perdagangan Saham Sektor Pertambangan.....	21
2.4.Penelitian Terdahulu	22
2.5.Kerangka Pikir	26
BAB III. METODOLOGI PENELITIAN	
3.1.Jenis Penelitian.....	28
3.2.Populasi dan Sampel	28
3.2.1.Populasi	28

3.2.2.Sampel.....	29
3.3.Definisi Operasional Variabel	29
3.4.Metode Analisis Datta.....	30
3.4.1.Event Study	30
3.5.Metode Pengumpulan Data.....	31
3.6.Teknik Analisa Data.....	33
3.6.1.Pengujian Hipotesis.....	33
3.6.1.1.Uji t Satu Sampel (One Sample t-test)	33
3.6.1.2.Uji t Dua Sampel Dependen (Paired Sample t Test).....	33
BAB IV.HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
4.1.Deskripsi Variabel Penelitian.....	35
4.1.1.Deskripsi Sampel Penelitian	35
4.2.Hasil Uji Deskriptif	36
4.2.1.Return Saham di sekitar Pengumuman Kenaikan BBM.....	36
4.2.2.Abnormal Return disekitar Pengumuman Kenaikan Harga BBM.....	38
4.2.3.Trading Volume Activity disekitar Pengumuman Kenaikan Harga BBM	40
4.3.Hasil Uji Hipotesis	42
4.3.1.Pengaruh Kenaikan Harga BBM Terhadap Abnormal Return	42
4.3.2.Pengaruh Kenaikan Harga BBM Terhadap Trading Volume Activity Sebelum dan Sesudah Pengumuman	43
4.4.Pembahasan.....	45
4.4.1.Terdapat Abnormal Return Saham Positif Signifikan Pada Sekitaran Pengumuman Kenaikan Harga BBM	45
4.4.2.Tidak Terdapat Perbedaan Trading Volume Activity Sebelum dan Sesudah Pengumuman Kenaikan Harga BBM	49
4.5.Implikasi Penelitian.....	50
BAB V. KESIMPULAN DAN SARAN	
5.1.Kesimpulan	52
5.2.Saran.....	52
DAFTAR PUSTAKA	54
LAMPIRAN.....	56

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Daftar harga saham emiten sector pertambangan	3
Tabel 3.1 Operasional Variabel.....	30
Tabel 4.1 Sampel penelitian.....	36
Tabel 4.2 Return Saham.....	37
Tabel 4.3 Average Abnormal Return	39
Tabel 4.4 Trading Volume Activity	41
Tabel 4.5 Hasil Uji One Sample T Test	43
Tabel 4.6 Hasil Uji Paired Sample T Test.....	44

DAFTAR GRAFIK

Grafik 4.1 Return Saham.....	37
Grafik 4.2 Abnormal Return	40
Grafik Trading Volume Activity.....	42

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. Data Return Masing-masing sampel.....	56
Lampiran 2 Data return ekspektasi masing-masing sampel.....	61
Lampiran 3. Daftar Abnormal retrn sampel	64
Lampiran 4. Daftar trading volume activity	65
Lampiran 5. Hasil Uji One Sample T Test.....	66
Lampiran 6. Hasil Uji Paired Sample T Test	67