

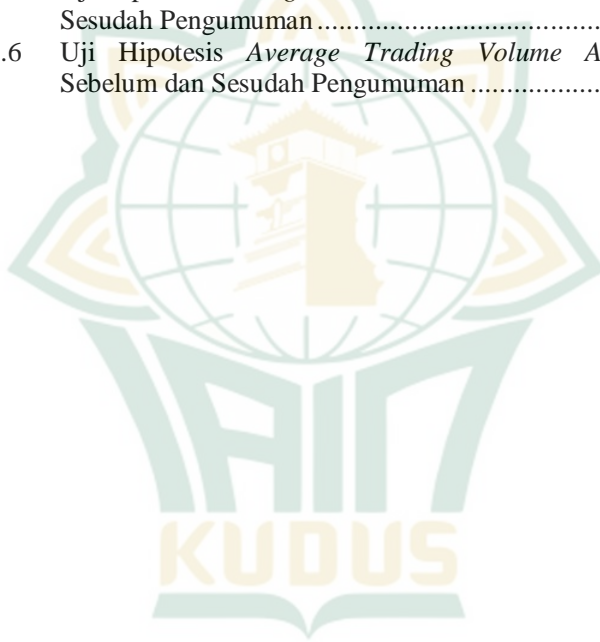
DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERSETUJUAN PEMBIMBING SKRIPSI.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN MUNAQOSYAH.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI.....	iv
HALAMAN ABSTRAK.....	v
HALAMAN MOTTO.....	vi
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	vii
PEDOMAN TRANSLITERASI ARAB-LATIN.....	viii
KATA PENGANTAR.....	ix
DAFTAR ISI.....	xi
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GAMBAR.....	xiv
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Rumusan Masalah.....	7
C. Tujuan Penelitian.....	7
D. Manfaat Penelitian.....	8
E. Sistematika Penulisan.....	8
BAB II LANDASAN TEORI	
A. Deskripsi Teori.....	10
1. <i>Efficient Market Hypothesis</i> (EMH).....	10
2. <i>Event Study</i> (Studi Peristiwa).....	11
3. <i>Abnormal Return</i>	14
4. <i>Trading Volume Activity</i>	18
5. Pasar Modal Syariah Indonesia.....	19
6. Indeks Saham Syariah Indonesia.....	24
B. Penelitian Tedahulu.....	24
C. Kerangka Berpikir.....	29
D. Hipotesis.....	30
1. Terdapat Perbedaan <i>Average Abnormal Return</i>	31
2. Terdapat Perbedaan <i>Trading Volume Activity</i>	32
BAB III METODE PENELITIAN	
A. Jenis dan Pendekatan.....	34
B. <i>Setting</i> Penelitian.....	34
C. Populasi dan Sampel.....	35
D. Desain dan Definisi Operasional Variabel.....	37

E. Teknik Pengumpulan Data	39
F. Teknik Analisis Data	40
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
A. Hasil Penelitian.....	42
1. Gambaran Obyek Penelitian	42
2. Analisis Data.....	42
B. Pembahasan Hasil Penelitian.....	48
1. Perbedaan Rata-rata <i>Abnormal Return</i> antara Sebelum dan Sesudah Pengumuman Kenaikan Harga BBM.....	49
2. Perbedaan Rata-rata <i>Trading Volume Activity</i> antara Sebelum dan Sesudah Pengumuman Kenaikan Harga BBM	52
BAB V PENUTUP	
A. Kesimpulan	55
B. Saran	55
DAFTAR PUSTAKA	
LAMPIRAN-LAMPIRAN	
DAFTAR RIWAYAT PENDIDIKAN	

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1	Data Harga BBM.....	2
Tabel 2.1	Penelitian Terdahulu.....	25
Tabel 3.1	Sampel Penelitian.....	36
Tabel 4.1	Statistik Deskriptif <i>Average Abnormal Return</i> Sebelum dan Sesudah Pengumuman.....	43
Tabel 4.2	Statistik Deskriptif <i>Average Trading Volume Activity</i> Sebelum dan Sesudah Pengumuman.....	44
Tabel 4.3	Uji Normalitas Data <i>Average Abnormal Return</i>	45
Tabel 4.4	Uji Normalitas Data <i>Average Trading Volume Activity</i>	46
Tabel 4.5	Uji Hipotesis <i>Average Abnormal Return</i> Sebelum dan Sesudah Pengumuman.....	47
Tabel 4.6	Uji Hipotesis <i>Average Trading Volume Activity</i> Sebelum dan Sesudah Pengumuman.....	47



DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1	Pergerakan Indeks ISSI 6 Bulan Terakhir Tahun 2022.....	3
Gambar 1.2	Return Rata-rata Saham Sektor Transportasi Sebelum dan Sesudah Pengumuman Kenaikan BBM (-10 hari dan +10 hari kerja bursa).....	4
Gambar 2.1	Periode Estimasi dan Periode Peristiwa	14
Gambar 2.2	Kerangka Berpikir.....	30

