

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL .....</b>	<b>i</b>
<b>PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULISAN .....</b>	<b>ii</b>
<b>HALAMAN PENGESAHAN .....</b>	<b>iii</b>
<b>HALAMAN PERSEMBAHAN .....</b>	<b>iv</b>
<b>MOTTO .....</b>	<b>vi</b>
<b>KATA PENGANTAR.....</b>	<b>vii</b>
<b>ABSTRACT .....</b>	<b>ix</b>
<b>ABSTRAK .....</b>	<b>x</b>
<b>DAFTAR ISI.....</b>	<b>xi</b>
<b>DAFTAR TABEL .....</b>	<b>xiv</b>
<b>DAFTAR GAMBAR.....</b>	<b>xv</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN .....</b>	<b>xvi</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
A. Latar Belakang.....	1
B. Rumusan Masalah .....	4
C. Tujuan Penelitian.....	5
D. Manfaat Penelitian.....	5
1. Bagi peneliti.....	5
2. Bagi investor dan calon investor.....	5
3. Bagi akademis .....	5
<b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....</b>	<b>6</b>
<b>A. Landasan Teori.....</b>	<b>6</b>
1. Informasi Asimetris ( <i>Asymmetric Information</i> ).....	6
2. <i>Event Study</i> .....	7
3. Pasar Modal .....	7
4. Reaksi Pasar.....	7
5. <i>Abnormal Return</i> .....	8

6. Likuiditas Saham Dan <i>Trading Volume Activity</i> .....	8
B. Penelitian Terdahulu .....	9
C. Hubungan Antar Variabel.....	13
1. Hubungan antara peristiwa larangan ekspor BBM Rusia 21 September 2023 dengan abnormal return pada Perusahaan Sektor Energi Industri Minyak dan Gas .....	13
2. Hubungan antara peristiwa larangan ekspor BBM Rusia 21 September 2023 dengan trading volume activity pada Perusahaan Sektor Energi Industri Minyak dan Gas.....	13
D. Kerangka Konseptual .....	14
E. Hipotesis .....	14
<b>BAB III METODE PENELITIAN .....</b>	<b>16</b>
A. Jenis Penelitian .....	16
B. Objek dan Waktu Penelitian .....	16
C. Populasi .....	18
D. Sampel dan Teknik Pengambilan sampel.....	18
E. Sumber Data .....	20
F. Periode Pengamatan .....	20
G. Teknik Pengumpulan Data .....	21
H. Variabel Penelitian .....	21
1. Abnormal Return .....	21
2. <i>Trading Volume Activity</i> (TVA) .....	21
I. Definisi Operasional Variabel .....	22
J. Teknik Analisis Data .....	24
1. Uji deskriptif .....	24
2. Uji Normalitas Data .....	26
3. Pengujian Hipotesis .....	27
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....</b>	<b>31</b>

A. Statistik Deskriptif.....	31
B. Uji Normalitas .....	32
1. Uji Normalitas <i>Abnormal Return</i> .....	33
2. Uji Normalitas <i>Average Trading Volume Activity</i> .....	34
C. Uji Hipotesis .....	35
1. Pengujian Hipotesis 1 .....	35
2. Uji Hipotesis 2 .....	37
3. Uji Hipotesis 3 .....	38
D. Pembahasan .....	39
1. Abnormal Return Yang Signifikan sebelum, saat, dan sesudah Tanggal Peristiwa Larangan Ekspor BBM Rusia 21 September 2023 .....	39
2. Pengaruh Peristiwa Larangan Ekspor BBM Rusia 21 September 2023 Terhadap <i>Abnormal Return</i> Sebelum dan Sesudah .....	40
3. Pengaruh Peristiwa Larangan Ekspor BBM Rusia 21 September 2023 Terhadap <i>Trading Volume Activity</i> .....	41
<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN .....</b>	<b>43</b>
A. Kesimpulan.....	43
B. Saran .....	43
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>45</b>
<b>LAMPIRAN.....</b>	<b>47</b>

## DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu .....	9
Tabel 3.1 Periode Peristiwa .....	17
Tabel 3.2 Kriteria Pengambilan Sampling .....	19
Tabel 3.3 Sampel penelitian .....	19
Tabel 3.4 Definisi Operasional Variabel.....	22
Tabel 4.1 Deskriptif Statistik Average Abnormal Return dan Average Trading Volume Activity .....	31
Tabel 4.2 Uji Normalitas Abnormal Return.....	33
Tabel 4.3 Uji Normalitas Trading Volume Activity .....	34
Tabel 4.4 Uji Signifikan Abnormal Return menggunakan One Sample t-test.....	35
Tabel 4.5 Uji Wilcoxon Signed Rank Test Average Abnormal Return.....	37
Tabel 4.6 Uji Wilcoxon Signed Rank Test Average Trading Volume Activity ...	38

## DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Grafik Volume Ekspor .....	3
Gambar 2.1 Kerangka Konseptual .....	14
Gambar 3.1 Event Study .....	21

## DAFTAR LAMPIRAN

LAMPIRAN 1 Sampel Penelitian Saham Perusahaan Sektor Energi Industri Minyak dan Gas .....	48
LAMPIRAN 2 Abnormal Return.....	50
LAMPIRAN 3 Trading Volume Activity .....	58
LAMPIRAN 4 Hasil Analisis Deskriptif .....	66
LAMPIRAN 6 Uji Normalitas Abnormal reTrading Volume Activity .....	68
LAMPIRAN 7 One Sample T-Test Abnormal Return .....	69
LAMPIRAN 8 Uji Non-Parametrik Wilcoxon Signed Rank Test Abnormal Return .....	70
LAMPIRAN 9 Uji Non-Parametrik Wilcoxon Signed Rank Test Trading Volume Activity.....	70