

**PERBEDAAN *ABNORMAL RETURN* DAN  
*TRADING VOLUME ACTIVITY* SEBELUM DAN SESUDAH  
PENGUMUMAN PP NOMOR 1 TAHUN 2014  
(Studi Pada Saham Sektor Pertambangan Yang *Listing* di ISSI)**

**DIAJUKAN UNTUK MEMENUHI SEBAGIAN PERSYARATAN  
DALAM MEMPEROLEH GELAR SARJANA EKONOMI  
DEPARTEMEN EKONOMI SYARIAH  
PROGRAM STUDI EKONOMI ISLAM**



**DIAJUKAN OLEH  
CYNTHIA PUTRI SURYADANING SENASTRI  
NIM: 041114031**

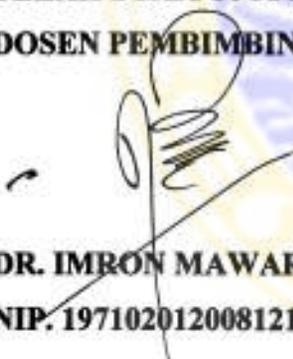
**FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS  
UNIVERSITAS AIRLANGGA  
SURABAYA  
2015**

**SKRIPSI**

**PERBEDAAN *ABNORMAL RETURN* DAN  
*TRADING VOLUME ACTIVITY* SEBELUM DAN SESUDAH  
PENGUMUMAN PP NOMOR 1 TAHUN 2014  
(Studi Pada Saham Sektor Pertambangan Yang *Listing* di ISSI)**

**DIAJUKAN OLEH:  
CYNTHIA PUTRI SURYADANING SENASTRI  
NIM: 041114031**

**TELAH DISETUJUI DAN DITERIMA DENGAN BAIK OLEH  
DOSEN PEMBIMBING,**

  
**DR. IMRON MAWARDI, SP., MSi.  
NIP. 197102012008121001**

**TANGGAL 16/2/2015**

**A.n PENGELOLA DEPARTEMEN EKONOMI SYARIAH  
PROGRAM STUDI EKONOMI ISLAM  
SEKRETARIS,**

  
**NOVENSUPRAYOGI, S.E., M.Si  
NIP. 19771105200812001**

**TANGGAL 16/2/2015**

## PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI

Saya, (Cynthia Putri Suryadaning Senastri, 041114031), menyatakan bahwa:

1. Skripsi saya ini adalah asli dan benar-benar hasil karya saya sendiri, dan bukan hasil karya orang lain dengan mengatasnamakan saya, serta bukan merupakan hasil peniruan atau penjiplakan (*plagiarism*) dari karya orang lain. Skripsi ini belum pernah diajukan untuk mendapatkan gelar akademik baik di Universitas Airlangga maupun di perguruan tinggi lainnya.
2. Dalam skripsi ini tidak terdapat karya atau pendapat yang telah ditulis atau dipublikasikan orang lain, kecuali secara tertulis dengan jelas dicantumkan sebagai acuan dengan disebutkan nama pengarang dan dicantumkan dalam daftar kepustakaan.
3. Pernyataan ini saya buat dengan sebenar-benarnya, dan apabila di kemudian hari terdapat penyimpangan dan ketidakbenaran dalam pernyataan ini, maka saya bersedia menerima sanksi akademik berupa pencabutan gelar yang telah diperoleh karena karya tulis skripsi ini, serta sanksi-sanksi lainnya sesuai dengan norma dan peraturan yang berlaku di Universitas Airlangga.

Surabaya, 16 Februari 2015



Cynthia Putri Suryadaning Senastri  
NIM: 041114031

## ***DECLARATION***

I, (Cynthia Putri Suryadaning Senastri, 041114031), declare that:

1. My thesis is genuine and truly my own creation, and is not another's person work made under my name, nor a piracy or plagiarism. This thesis has never been submitted to obtain an academic degree in Airlangga University or in any other universities/colleges.
2. This thesis does not contain any work or opinion written or published by anyone, unless clearly acknowledge or referred to by quoting the author's name and stated in the references.
3. This statement is true, if on the future this statement is proven to be fraud and dishonest, I agree to receive an academic sanction in the form of removal of the degree obtained through this thesis, and other sanctions in accordance with the prevailing norms and regulations in Airlangga University.

Surabaya, February 16<sup>th</sup> 2015



Cynthia Putri Suryadaning Senastri  
NIM: 041114031

## KATA PENGANTAR

*Assalamu'alaikum Wr. Wb.*

Puji syukur kehadiran Allah SWT yang telah melimpahkan rahmat dan hidayah-Nya, sehingga penulis dapat menyelesaikan skripsi ini dengan lancar dan tepat waktu. Shalawat serta salam senantiasa tercurah kepada Nabi Muhammad SAW beserta keluarga dan pengikutnya.

Skripsi berjudul “Perbedaan *Abnormal Return* dan *Trading Volume Activity* Sebelum dan Sesudah Pengumuman PP Nomor 1 Tahun 2014 (Studi Pada Saham Sektor Pertambangan yang *Listing* di ISSI)” ini merupakan salah satu persyaratan akademik untuk memperoleh gelar Sarjana Ekonomi Program Studi Ekonomi Islam, Fakultas Ekonomi dan Bisnis (FEB) Universitas Airlangga Surabaya.

Skripsi ini tidak akan terwujud tanpa dukungan, doa, semangat dan bantuan baik moral maupun material dari berbagai pihak. Oleh karena itu, pada kesempatan kali ini penulis mengucapkan terima kasih kepada:

1. Prof. Dr. Muslich Anshori, SE., M.Sc., Ak., sebagai dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Airlangga Surabaya.
2. Drs. Ec. H. Suherman Rosyidi, S.E, M.Com., sebagai Ketua Departemen Ekonomi Syariah, Program Studi Ekonomi Islam Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Airlangga Surabaya.
3. Dr. Imron Mawardi, SP., MS.i, sebagai dosen pembimbing. Terima kasih telah bersedia meluangkan waktu, tenaga, pikiran dan kesabarannya dalam membimbing, sehingga penulis mampu menyelesaikan skripsi ini dengan lancar dan tepat waktu.
4. Bapak-Ibu dosen Departemen Ekonomi Syariah Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Airlangga. Terimakasih atas semua ilmu yang dengan ikhlas dibagi kepada penulis.
5. Bapak-Ibu dosen Fakultas Ekonomi dan Bisnis yang telah memberikan ilmunya selama masa kuliah.
6. Seluruh staf dan karyawan Fakultas Ekonomi dan Bisnis (Pak Kasdullah, Bu Dewi, Pak Andi, staf akademik, kemahasiswaan, keuangan, dll)

terima kasih telah membantu dan memberikan penulis banyak kemudahan selama masa perkuliahan.

7. Kedua orang tua penulis, Bapak Sugeng Suryanto S.Ap., M.A.P., dan Ibu Dra. Ida Ratnawati. Terimakasih atas semua doa, motivasi, fasilitas, perhatian, dan nasihatnya selama ini hingga penulis dapat menyelesaikan skripsi dengan baik.
8. Keluarga penulis, khususnya dua saudara penulis, Bintang Senna Sakti Surya Wiranegara dan Alandra Devi Suryaputri Aziza, “*thanks for always brighten up my day.*”
9. Kepada Ganda Lesmana, terimakasih atas semua doa, dukungan dan bantuannya selama ini. Segera lulus, semoga bisa sukses sama-sama.
10. Kepada sahabat-sahabat penulis sejak SMP (Adita, Nurul, Reni) terimakasih atas doa dan dukungannya selama ini.
11. Kepada sahabat-sahabat penulis lainnya, Iin, Cicha, Farina, Ira, Suci, Mufaidah, Faricha. Terimakasih atas doa dan dukungan yang selalu diberikan kepada penulis selama ini.
12. Teman-teman kos Karangmenjangan 6, Nur Fadilla, Nina Karina, Hikmania, Resti, Devi, Mbak Rima, Mbak Dhini, Mbak Lily, Mbak Shima, dll) terimakasih atas semua keceriaannya dan bantuannya selama ini.
13. Teman-teman satu bimbingan skripsi, Ira, Richa, Suci, Linda, Ajeng, Iis, Mbak Wulan, Mas Rahmat, Aulia, Oki, Mae, Mas Rahman, terimakasih atas kerjasama, bantuan, dan dukungannya selama proses penyelesaian skripsi.
14. Teman-teman Divisi PSDM HIMA Ekonomi Islam Periode 2013, terimakasih sudah menjadi *partner* yang luar biasa.
15. Teman-teman Ekonomi Islam khususnya angkatan 2011, terima kasih atas bantuan dan dukungannya selama penulis kuliah.
16. Teman-teman KKN BBM angkatan 49 Kelurahan Kemamang, Bojonegoro, terimakasih atas kerjasamanya dan pengalaman yang luar biasa.

17. Semua pihak yang tidak dapat disebutkan satu persatu yang berperan dalam proses penyelesaian penulisan skripsi ini..

Penulis sangat menyadari bahwa skripsi ini jauh dari sempurna. Oleh karena itu, penulis sangat mengharapkan kritik dan saran yang bersifat membangun dari pembaca. Akhir kata, dengan segala keterbatasan semoga skripsi ini bermanfaat bagi semua pihak yang membutuhkan.

*Wassalamu'alaikum Wr. Wb.*



Surabaya, 16 Februari 2015

Cynthia Putri Suryadaning Senastri

NIM: 041114031