

## ABSTRAK

### **DAMPAK PENGUMUMAN *BOND RATING* TERHADAP AKTIVITAS VOLUME PERDAGANGAN SAHAM Studi Empiris pada Perusahaan yang Terdaftar di Bursa Efek Jakarta Tahun 2002**

**LUH GDE MEI LESTARI  
UNIVERSITAS SANATA DHARMA  
YOGYAKARTA  
2003**

Tujuan penelitian ini adalah untuk mengetahui bagaimana dampak pengumuman *bond rating* terhadap aktivitas volume perdagangan saham. Penelitian ini merupakan studi empiris dengan menggunakan metode studi kasus<sup>peristiwa.</sup> pada perusahaan yang terdaftar di Bursa Efek Jakarta yang melakukan pengumuman *bond rating* periode 2002.

Penelitian ini meliputi 12 perusahaan yang melakukan pengumuman *bond rating* periode 2002. Pengumpulan data dilakukan dengan pencatatan terhadap data yang sudah dipublikasikan oleh Bursa Efek Jakarta dan PT PEFINDO dengan 10 hari periode jendela. Teknik analisis data yang digunakan adalah analisa varians.

Hasil penelitian dan analisis data dari sampel sebanyak 12 perusahaan yang terdaftar di PT. Bursa Efek Jakarta menunjukkan bahwa pengumuman *bond rating* tidak berdampak terhadap aktivitas volume perdagangan saham sebelum, saat dan sesudah pengumuman *bond rating*.

## **ABSTRACT**

### **THE EFFECT OF BOND RATING ANNOUNCEMENT TOWARD TRADING ACTIVITIES ON STOCK VOLUME An Empirical Study at the Companies Listed at The Jakarta Stock Exchange in 2002**

**LUH GDE MEI LESTARI  
SANATA DHARMA UNIVERSITY  
YOGYAKARTA  
2003**

The aim of the research was to find out the effect of bond rating announcement toward trading activities on stock volume. This research was an empirical study using event study method on the listing companies at Jakarta Stock Exchange which announced bond rating in 2002.

The research examined 12 companies that announced their bond rating in 2002. The data gathering was conducted by recording data which had been published by Jakarta Stock Exchange and PT. PEFINDO with a 10 days window. The technique used to analyze data was variance analysis.

The result of the research of 12 companies which listed at The Jakarta Stock Exchange showed that bond rating announcement had no effect toward trading activities on stock volume before, at and after bond rating announcement.