

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
PERSETUJUAN PEMBIMBING SKRIPSI	ii
HALAMAN PENGESAHAN	iii
LEMBAR PERNYATAAN	iv
ABSTRAK	v
MOTTO	vi
PERSEMBAHAN	vii
PEDOMAN TRANSLITERASI ARAB-LATIN	ix
KATA PENGANTAR	x
DAFTAR ISI	xii
DAFTAR TABEL	xiv
DAFTAR GAMBAR	xv
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Rumusan Masalah	7
C. Tujuan Penelitian	8
D. Manfaat Penelitian.....	8
E. Sistematika Penulisan	9
BAB II LANDASAN TEORI	
A. Deskripsi Teori	10
1. Investasi	10
2. Pasar Modal	16
3. <i>Return Saham</i>	19
4. <i>Abnormal Return</i>	20
5. <i>Trading Volume Activity</i>	21
6. Cukai	21
7. Studi Peristiwa (<i>Event Study</i>)	27
B. Penelitian Terdahulu	28
C. Kerangka Berfikir.....	31
D. Hipotesis Penelitian	32
BAB III METODE PENELITIAN	
A. Jenis dan Pendekatan	34
B. Setting Penelitian.....	35
C. Populasi dan Sampel	35
D. Desain dan Definisi Operasional Variabel	35

E. Teknik Pengumpulan Data	39
F. Teknik Analisis Data.....	39
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
A. Hasil Penelitian.....	42
1. Gambaran Obyek Penelitian.....	42
2. Analisis Data Penelitian.....	42
B. Pembahasan Hasil Analisis Data.....	59
BAB V PENUTUP	
A. Simpulan	62
B. Keterbatasan Penelitian	62
C. Saran	63
DAFTAR PUSTAKA	
LAMPIRAN-LAMPIRAN	
DAFTAR RIWAYAT HIDUP	



DAFTAR TABEL

Tabel 2.1	Batasan Harga Jual Eceran Per Batang Atau Gram dan Tarif Cukai Per Batang atau Gram Hasil Tembakau Buatan dalam Negeri.....	24
Tabel 2.2.	Batasan Harga Jual Eceran Terendah Per Batang atau Gram dan Tarif Cukai Per Batang atau Gram Hasil Tembakau yang diimpor.....	26
Tabel 4.1	Daftar Nama Emiten yang Dijadikan Sampel Penelitian	42
Tabel 4.2	<i>Actual Return</i> Saham Sebelum dan Sesudah Pengumuman	44
Tabel 4.3	<i>Expected Return</i> Sebelum dan Sesudah Pengumuman	46
Tabel 4.4	<i>Abnormal Return</i> Sebelum dan Sesudah Pengumuman	47
Tabel 4.5	<i>Trading Volume Activity</i> Sebelum dan Sesudah Pengumuman	49
Tabel 4.6	Statistik Deskriptif	50
Tabel 4.7	Uji Normalitas Data (<i>Abnormal Return</i>)	53
Tabel 4.8	Uji Normalitas Data (<i>Trading Volume Activity</i>).....	54
Tabel 4.9	Statistik Uji <i>Paired Sample T-Test Abnormal Return</i>	55
Tabel 4.10	Uji <i>Paired Sample T-Test Abnormal Return</i>	56
Tabel4.11	Statistik Uji <i>Paired Sample T-Test Trading Volume Activity</i>	57
Tabel 4.12	Uji <i>Paired Sample T-Test Trading Volume Activity</i>	57

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Penjualan Perusahaan Rokok Tahun 2016-2018 3

Gambar 2.1 Kandungan Informasi Suatu Pengumuman Peristiwa 28

Gambar 2.2 Model Kerangka Berfikir Penelitian 31

