

DAFTAR ISI

Halaman

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN	ii
HALAMAN PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
ABSTRAK	v
<i>ABSTRACT</i>	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR	xv
DAFTAR LAMPIRAN	xvi
BAB I : PENDAHULUAN	
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Rumusan Masalah	8
1.3. Tujuan Penelitian dan Manfaat Penelitian	9
1.3.1. Tujuan Penelitian	9
1.3.2. Manfaat Penelitian	10
1.4. Sistematika Penulisan	11
BAB II : TINJAUAN PUSTAKA	
2.1 Landasan Teori	13
2.1.1 Teori Ekspektasi Rasional	13
2.1.2 Efisiensi Pasar	14
2.1.3 Saham	17
2.1.4 Pemecahan Saham (Stock Split)	20
2.1.4.1 Jenis Stock Split	21
2.1.4.2 Alasan Perusahaan Melakukan Stock Split	23
2.1.4.3 Manfaat Stock Split	24

2.1.4.4 Teori dalam Stock Split	27
2.1.5 Harga Saham	28
2.1.6 Abnormal Return	29
2.1.7 Volume Perdagangan Saham	32
2.2 Penelitian Terdahulu	33
2.3 Kerangka Pemikiran	36
2.4 Hipotesis	37
BAB III : METODE PENELITIAN	
3.1 Variabel Penelitian	41
3.2 Definisi Operasional Variabel	41
3.3 Populasi dan Sampel	45
3.4 Jenis dan Sumber Data	49
3.5 Metode Pengumpulan Data	50
3.6 Metode Analisis	50
3.7 Alat-alat Pengujian Hipotesis	51
BAB IV : HASIL DAN PEMBAHASAN	
4.1 Statistik Deskriptif	57
4.1.1 Deskripsi Perusahaan Bertumbuh dan Tidak Bertumbuh	57
4.1.2 Deskripsi Average Abnormal Return Saham	58
4.1.3 Deskripsi Volume Perdagangan Saham	59
4.2 Analisis Data	60
4.2.1 Uji Normalitas Data	61
4.2.2 Pengujian Hipotesis	62
4.2.2.1 Pengujian Hipotesis 1	62
4.2.2.2 Pengujian Hipotesis 2	64
4.2.2.3 Pengujian Hipotesis 3	66
4.2.2.4 Pengujian Hipotesis 4	68
4.2.2.5 Pengujian Hipotesis 5	70
4.2.2.6 Pengujian Hipotesis 6	71

4.3 Pembahasan	72
4.3.1 Pembahasan Hasil Pengujian Hipotesis 1	72
4.3.2 Pembahasan Hasil Pengujian Hipotesis 2	74
4.3.3 Pembahasan Hasil Pengujian Hipotesis 3	74
4.3.4 Pembahasan Hasil Pengujian Hipotesis 4	75
4.3.5 Pembahasan Hasil Pengujian Hipotesis 5	76
4.3.6 Pembahasan Hasil Pengujian Hipotesis 6	77
BAB V : PENUTUP	
5.1 Kesimpulan	78
5.2 Keterbatasan	78
5.3 Saran	79
DAFTAR PUSTAKA	81
LAMPIRAN	84