

DAFTAR ISI

Halaman

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
MOTTO	v
ABSTRACT	vi
ABSTRAK	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
DAFTAR LAMPIRAN	xv
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Perumusan Masalah	14
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian	16
1.4 Sistematika Penulisan	17
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	
2.1 Konsep Dasar	18
2.1.1 Pemecahan Saham (<i>Stock Split</i>).....	18
2.1.2 Jenis <i>Stock Split</i>	22
2.1.3 Pasar Efisien.....	23
2.1.4 Teori <i>Stock Split</i>	26
2.1.4.1 <i>Signalling Theory</i>	26
2.1.4.2 <i>Optimal Trading Range Theory</i>	28
2.1.5 <i>Abnormal Return</i>	29
2.1.6 Risiko Sistematis.....	30
2.1.6.1 Pengertian Risiko	30
2.1.6.2 Beta	34
2.1.7 Volume Perdagangan Saham (TVA)	36
2.1.8 <i>Event Study</i>	37
2.1.9 Hubungan <i>Stock Split</i> dengan <i>Abnormal Return</i>	38
2.1.10 Hubungan <i>Stock Split</i> dengan Risiko Sistematis.....	40
2.1.11 Hubungan <i>Stock Split</i> dengan TVA	41
2.2 Penelitian Terdahulu	42
2.3 Kerangka Pemikiran.....	48
2.4 Perumusan Hipotesis.....	50

BAB III METODE PENELITIAN	
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional	51
3.1.1 Variabel Penelitian	51
3.1.2 Definisi Variabel Operasional.....	51
3.2 Populasi dan Sampel	54
3.3 Jenis dan Sumber Dana	56
3.4 Metode Pengumpulan Data	57
3.5 Metode Analisis	57
3.5.1 Analisis Statistik Deskriptif	58
3.5.2 Uji Normalitas	59
3.5.3 Uji Hipotesis	59
3.5.3.1 Paired Sample T-Test (Uji Sampel Berpasangan)	60
3.5.5.2 Wilcoxon Signed Rank Test.....	61
 BAB IV HASIL PENELITIAN DAN ANALISIS DATA	
4.1 Deskripsi Objek Penelitian.....	63
4.2 Analisis Data	65
4.2.1 <i>Abnormal Return</i> Sebelum dan Sesudah <i>Stock Split</i>	65
4.2.2 Risiko Sistematis Sebelum dan Sesudah <i>Stock Split</i>	70
4.2.3 TVA Sebelum dan Sesudah <i>Stock Split</i>	74
4.3 Pembahasan.....	77
 BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	
5.1 Kesimpulan	81
5.2 Keterbatasan Penelitian.....	82
5.3 Saran	83
 DAFTAR PUSTAKA	85
LAMPIRAN.....	88