

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
ABSTRAK	xiii
ABSTRACT	xiv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang Penelitian.....	1
1.2. Rumusan Masalah	6
1.3. Tujuan Penelitian.....	7
1.4. Manfaat Penelitian.....	7
BAB II KAJIAN PUSTAKA	8
2.1 Landasan Teori	8
2.1.1 Signaling Theory	8
2.1.2 Trading Range Theory.....	9
2.1.3 Pasar Modal.....	10
2.1.4 Pasar Modal yang Efisien.....	11
2.1.5 Event Study	15
2.2 Variabel-variabel penelitian dan pengembangan hipotesis	17
2.2.1 Pemecahan Saham.....	17

2.2.2	Volume Perdagangan Saham.....	20
2.2.3	<i>Abnormal Return</i>	22
2.2.4	Harga Saham	23
2.2.5	<i>Stock Split</i> terhadap TVA.....	25
2.2.6	<i>Stock Split</i> terhadap <i>Average Abnormal Return</i>	27
2.3	Model Empirik.....	29
BAB III METODE PENELITIAN		30
3.1.	Jenis Penelitian	30
3.2.	Variabel dan Indikator Penelitian.....	31
3.3.	Populasi dan sampel	32
3.4.	Sumber dan Metode pengumpulan data	33
3.5.	Teknik Analisis.....	33
3.6.	Metode Analisis.....	34
3.6.1	Alat analisis	34
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		38
4.1	Gambaran Umum Obyek Penelitian.....	38
4.2	Statistik Deskriptif.....	40
4.3	Pengujian Hipotesis	44
4.3.1	Pengujian Perbedaan TVA Sebelum Dan Sesudah Pengumuman Stock split.....	44
4.3.2	Pengujian Perbedaan Abnormal Return Saham Sebelum Dan Sesudah Pengumuman Stock split.....	46
4.4	Pembahasan	47
4.4.1	Perbedaan TVA Sebelum Dan Sesudah Pengumuman Stock split.....	47
4.4.2	Perbedaan Abnormal Return Sebelum Dan Sesudah Pengumuman Stock split.....	49

BAB V PENUTUP	51
5.1 Kesimpulan.....	51
5.2 Saran.....	52
5.3 Keterbatasan	52
5.4 Implikasi Penelitian Yang Akan Datang	53
DAFTAR PUSTAKA	54
LAMPIRAN.....	57

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1. Daftar Perusahaan yang Melakukan <i>Stock Split</i> di Bursa Efek Indonesia Periode 2011-2015.....	5
Tabel 2.1 Definisi Operasional dan Variabel	31
Tabel 3.1 Daftar Perusahaan Melakukan Stock split Tahun 2011-2015.....	39
Tabel 4.1 Statistik Deskriptif.....	40
Tabel 4.2 Normalitas Data.....	43
Tabel 4.3 Hasil Uji Beda TVA Sebelum dan Sesudah Pengumuman Stock split.....	45
Tabel 4.4 Hasil Uji Beda Abnormal Return Saham Sebelum dan Sesudah Pengumuman Stock split.....	46

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1. Model Empirik	29
---------------------------------	----