



DAFTAR ISI

LEMBAR JUDUL	i
LEMBAR PENGESAHAN.....	ii
LEMBAR PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
DAFTAR ISI.....	v
DAFTAR TABEL	viii
DAFTAR GAMBAR	ix
DAFTAR LAMPIRAN	x
INTISARI.....	xi
ABSTRACT	xii
BAB 1 PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Pertanyaan Penelitian	5
1.4 Manfaat Penelitian.....	5
1.5 Lingkup Penelitian.....	6
1.6 Sistematika Penulisan.....	6
BAB 2 LANDASAN TEORI.....	8
2.1 Landasan Teori	8
2.1.1 <i>Event Study</i>	8
2.1.2 <i>Stock Split</i>	8
2.1.3 <i>Abnormal Return</i>	10
2.1.4 Likuiditas	11
2.1.5 Volatilitas	12
2.2 Penelitian Terdahulu.....	12
2.3 Perumusan Hipotesis	14
2.3.1 Hipotesis <i>Signaling Theory</i>	14
2.3.2 Hipotesis <i>Trading Range Theory</i>	15
2.3.3 Hipotesis Volatilitas	15
2.3.4 Hipotesis CAR	16



BAB 3 METODE PENELITIAN	17
3.1 Desain Penelitian	17
3.2 Variabel	18
3.2.1 Variabel Dependen	18
3.2.2 Variabel Independen	20
3.2.2.1 Likuiditas	20
3.2.2.2 Volatilitas	20
3.2.3 Variabel Kontrol	21
3.3 Metode Analisis Data	21
BAB 4 HASIL DAN PEMBAHASAN	23
4.1 Data Penelitian.....	23
4.2 Hasil Uji Hipotesis	23
4.2.1 Statistika Deskriptif.....	23
4.2.2 Uji Hipotesis	24
4.2.2.1 Uji Hipotesis 1	24
4.2.2.2 Uji Hipotesis 2	26
4.2.2.3 Uji Hipotesis 3	27
4.2.2.4 Uji Hipotesis 4	29
4.2.2.5 Uji Hipotesis 5	30
4.2.2.6 Uji Hipotesis 6	32
4.2.2.7 Uji Hipotesis 7	33
4.3 Pembahasan Hasil Penelitian.....	37
4.3.1 Pengaruh <i>Stock Split</i> Terhadap <i>Abnormal Return</i>	37
4.3.2 Pengaruh <i>Stock Split</i> Terhadap Likuiditas.....	37
4.3.3 Pengaruh <i>Stock Split</i> Terhadap Volatilitas.....	38
4.3.3 Pengaruh Likuiditas, Volatilitas, dan Market Cap terhadap CAR	39
BAB V PENUTUP.....	41
5.1 Kesimpulan.....	41
5.2 Implikasi	41
5.3 Keterbatasan	42
5.4 Saran	43



DAFTAR PUSTAKA.....	44
LAMPIRAN	46