

DAFTAR ISI

LEMBAR JUDUL.....	i
LEMBAR PENGESAHAN.....	ii
LEMBAR PERNYATAAN.....	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR GAMBAR.....	ix
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
INTISARI.....	xiii
ABSTRACT.....	xiv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Rumusan Masalah.....	6
1.2 Tujuan Penelitian.....	6
1.3 Manfaat Penelitian.....	6
1.4 Batasan Penelitian.....	7
1.5 Sistematika penulisan.....	7
BAB II LANDASAN TEORI.....	10
2.1 Pasar Modal.....	10
2.2 <i>Stock split</i>	11
2.2.1 <i>Jenis Stock split</i>	12
2.2.2 <i>Alasan Melakukan Stock split</i>	13
2.2.3 <i>Kerugian Melakukan Stock split</i>	14
2.3 Teori <i>Stock Split</i>	14
2.3.1 <i>Trading Range Theory</i>	14
2.3.2 <i>Signalling Theory</i>	15
2.4 Dampak <i>Stock Split</i> Terhadap <i>Return Saham</i>	16
2.5 Likuiditas Saham.....	19
2.6 Teori harga saham.....	21

2.7	Pasar Efisiensi (<i>Efficient Market</i>).....	22
2.8	Study Peristiwa (<i>Event Study</i>).....	24
2.8.1	<i>Tujuan Studi Peristiwa</i>	24
2.8.2	<i>Tahapan Studi Peristiwa</i>	26
2.9	<i>Return</i>	27
2.10	<i>Abnormal Return</i>	29
2.11	Hipotesis Penelitian.....	30
BAB III METODE PENELITIAN		33
3.1	Populasi dan Pengumpulan sampel.....	33
3.2	Periode Penelitian.....	35
3.3	Sumber dan Pengambilan Data	36
3.4	Definisi Operasional Variabel	37
3.4.1	<i>Abnormal Return</i>	37
3.5	Metode Analisis.....	37
3.5.1	<i>Hipotesis 1</i>	37
3.5.2	<i>Hipotesis 2</i>	42
BAB IV HASIL ANALISIS DAN PEMBAHASAN.....		44
4.1	Hasil Hipotesis Pertama	46
4.2	Hasil Hipotesis Kedua	49
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN		53
5.1	Kesimpulan.....	53
5.2	Saran.....	54
DAFTAR PUSTAKA.....		56