

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN	vi
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR	xi
INTISARI.....	xii
<i>ABSTRACT</i>	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	8
1.3 Tujuan Penelitian.....	9
1.4 Manfaat Penelitian.....	9
1.5 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian.....	10
1.6 Sistematika Penelitian	10
BAB II LANDASAN TEORI DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS	12
2.1 Tinjauan Pustaka	12
2.1.1 Pasar Modal.....	12
2.1.2 Efisiensi Pasar	15
2.1.3 <i>Event Study</i>	16
2.1.4 <i>Signaling Hypothesis</i>	17
2.1.5 <i>Stock Split</i>	18
2.1.6 <i>Return</i>	20
2.2 Penelitian Terdahulu.....	23
2.3 Pengembangan Hipotesis	24

BAB III METODE PENELITIAN.....	25
3.1 Desain Penelitian	25
3.2 Data Penelitian	25
3.3 Populasi dan Sampel Penelitian	26
3.5 Periode Peristiwa.....	29
3.5 Periode Estimasi	31
3.6 Model Pengujian Hipotesis	32
3.7 Teknik Pengujian Normalitas Data dan Hipotesis	34
3.7.1 Pengujian Normalitas Data	34
3.7.2 Pengujian Hipotesis.....	35
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	36
4.1 Deskripsi Data	36
4.1.1 Data	36
4.1.2 Statistik deskriptif	36
4.1.3 Uji normalitas.....	39
4.2 Uji Hipotesis.....	40
BAB V KESIMPULAN.....	44
5.1 Kesimpulan.....	44
5.2 Keterbatasan Penelitian	45
5.3 Saran.....	46
5.4 Implikasi Penelitian	46
DAFTAR PUSTAKA	48
LAMPIRAN.....	51
Lampiran 1. <i>AVERAGE RETURN SAHAM</i>	51
Lampiran 2. <i>ACTUAL RETURN SAHAM</i>	52
Lampiran 3. <i>EXPECTED RETURN SAHAM</i>	55
Lampiran 4. <i>ABNORMAL RETURN SAHAM</i>	58
Lampiran 5. UJI DESKRIPTIF	60
Lampiran 6. <i>ONE SAMPLE T- TEST</i>	62

DAFTAR TABEL

Tabel 1. Total Perdagangan IHSG periode 2015-2019	2
Tabel 2. Daftar Perusahaan Melakukan <i>Stock Split</i> Periode 2014 - 2018.....	27
Tabel 3. Statistik Deskriptif <i>Return</i> Saham - Saham Sampel	37
Tabel 4. Statistik Deskriptif <i>Abnormal Return</i>	37
Tabel 5. Hasil Uji Normalitas <i>Abnormal Return</i> Hari – Hari Selama Periode Penelitian.....	40
Tabel 6. Uji Signifikansi <i>Average Abnormal Return</i>	42

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1. Periode Peristiwa Penelitian.....	31
Gambar 2. Periode Penelitian Menyeluruh.....	32