



DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN	i
HALAMAN PERNYATAAN.....	ii
KATA PENGANTAR.....	iii
DAFTAR ISI	iv
DAFTAR TABEL	vi
DAFTAR GAMBAR.....	vii
DAFTAR LAMPIRAN	viii
INTISARI.....	ix
ABSTRACT	x
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	5
1.3 Pertanyaan Penelitian.....	5
1.4 Tujuan Penelitian	6
1.5 Manfaat Penelitian	6
1.6 Lingkup Penelitian.....	6
BAB II KAJIAN PUSTAKA	9
2.1 Landasan Teori	9
2.1.1 <i>Signaling Theory</i>	9
2.1.2 <i>Neglected Firm Effect</i>	9
2.2 Pemecahan Saham (<i>Stock Split</i>).....	10
2.3 <i>Event Study</i>	11
2.3.1 <i>Tipe Event Study</i>	12
2.3.2 <i>Tahapan Event Study</i>	14
2.4 <i>Abnormal Return</i>	15
2.5 Ukuran Perusahaan	17
2.6 Kajian Penelitian Terdahulu	18
2.7 Perumusan Hipotesis.....	19
2.7.1 <i>Hipotesis Signaling</i>	19
2.7.2 <i>Hipotesis Neglected Firm</i>	20
BAB III METODA PENELITIAN.....	21



3.1	Desain Penelitian	21
3.2	Metoda Pengumpulan Data.....	21
3.3	Definisi Operasional	22
3.3.1	<i>Event Study</i>	22
3.3.2	Variabel Dependen	26
3.3.3	Variabel Independen.....	26
3.4	Metoda Analisis Data.....	27
3.4.1	Uji Asumsi Klasik	28
3.4.2	Pengujian Hipotesis	30
3.4.3	Langkah Pengujian Hipotesis	31
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN		33
4.1	Deskripsi Data.....	33
4.2	Pengujian Hipotesis 1	34
4.2.1	AAR dan CAAR.....	34
4.2.2	Uji <i>One Sample T-test</i>	36
4.3	Pengujian Hipotesis 2	37
4.3.1	Uji Asumsi Klasik	38
4.3.2	Analisis Regresi Berganda.....	41
4.3.3	Uji Statistik t.....	43
4.4	Diskusi dan Pembahasan	43
4.4.1	<i>Abnormal return</i>	43
4.4.2	Hubungan antara ukuran perusahaan dengan <i>abnormal return</i>	45
BAB V SIMPULAN.....		47
5.1	Simpulan	47
5.2	Keterbatasan.....	48
5.3	Saran	48
DAFTAR PUSTAKA.....		50
LAMPIRAN		52