DAFTAR ISI

ABSTRACK **..... vii**

ABSTRAK viii

KATA PENGANTAR ix

DAFTAR ISI xii

DAFTAR GAMBAR..... xv

DAFTAR TABEL xvi

BAB I. PENDAHULUAN 1

I.1. Latar Belakang Penelitian 1

I.2 Identifikasi Masalah …… 6

I.3. Rumusan Masalah 7

I.4. Tujuan Penelitian.....7

I.5. Manfaat Penelitian 7

1.5.1 Manfaat Secara Akademis …… 7

1.5.2 Manfaat Secara Operasional ..…… 8

I.6. Keterbatasan Penelitian 8

I.7. Jadwal Kegiatan Penelitian …….....9

BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS 10

2.1. Kajian Teori dan Penelitian Terdahulu 10

2.1.1. Teori-Teori Mengenai Stock Split 10

2.1.2. Stock Plit.....12

2.1.3. Jenis Stock Split 14

2.1.4. Harga Saham.....15

2.1.5. Volume Perdagangan.....16

2.1.6. Return Saham (Ri) 17

2.1.7. Abnormal Return.....18

2.1.8. Event Study.....21

2.2. Penelitian yang Relevan 22

2.3. Kerangka Pemikiran 25

2.3.1. Pengaruh Stock Split Terhadap Harga Saham 24
2.3.2. Pengaruh Stock Split Terhadap Volume Perdagangan Saham 24
2.3.3. Pengaruh Stock Split Terhadap Abnormal Return.....25
2.4. Hipotesis Penelitian 27
BAB III METODE PENELITIAN 28
3.1. Jenis Penelitian dan Metode yang Digunakan.....28
3.2 Operasionalisasi Variabel..... 29
3.3. Jenis dan Sumber Data 30
3.4. Penentuan Populasi, Sampel dan Teknik Pengumpulan Data 31
3.4.1. Penentuan Populasi.....32
3.4.2. Teknik Penentuan Sampel.....32
3.4.3. Teknik Pengumpulan Data 34
3.5. Rancangan Analisis Data dan Uji Hipotesis 35
3.5.1. Analisis Data.....35
3.5.2. Uji Asumsi Klasik 35
3.5.3. Pengujian Hipotesis.....42
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....45
4.1. Hasil Penelitian.....45
4.1.1 Gambaran Unit Penelitian.....45
4.1.2 Deskripsi Hasil Penelitian..... .61
4.1.3 Analisis Data..... 63
4.2. Pengujian Hipotesis 66
4.2.1. Hipotesis Pertama.....67
4.2.2. Hipotesis Kedua 69
4.2.3. Hipotesis Ketiga 71
4.3. Pembahasan dan Hasil Penelitian 73
4.3.1. Hipotesis Pertama 73
4.3.2. Hipotesis Kedua 73
4.3.3. Hipotesis Ketiga 74

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN 75
5.1. Kesimpulan 75
5.2. Saran 76
DAFTAR PUSTAKA .....
LAMPIRAN .....