

DAFTAR ISI

	Halaman
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR.....	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
I. PENDAHULUAN	
1.1.Latar Belakang.....	1
1.2.Rumusan Masalah.....	7
1.3.Tujuan Penelitian.....	7
1.4.Manfaat Penelitian.....	7
1.5.Kerangka Pemikiran.....	8
1.6.Hipotesis.....	11
II. TINJAUAN PUSTAKA	
2.1 Pasar Modal.....	13
2.2 Efisiensi Pasar Modal.....	13
2.3 Pemecahan Saham (<i>Stock Split</i>).....	14
2.3.1 Teori Pemecahan Saham.....	22
2.3.2 Jenis Pemecahan Saham.....	24
2.3.3 Manfaat Pemecahan Saham.....	26

2.3.4 Kerugian Pemecahan Saham.....	26
2.4 <i>Return</i> Saham.....	27
2.5 <i>Abnormal Return</i>	30
2.5.1 Jenis-Jenis <i>Abnormal Return</i>	31
2.5.2 Pengaruh Pemecahan Saham Terhadap <i>Abnormal Return</i>	32
2.6 Volume Perdagangan Saham (<i>Trading Volume Activity</i>).....	32
2.6.1 Pengaruh Pemecahan Saham Terhadap Volume Perdagangan Saham	33
2.7 Likuiditas Saham.....	34
2.8 <i>Event Study</i>	35
2.9 Penelitian Terdahulu.....	37
III. METODE PENELITIAN	
3.1 Sifat Penelitian.....	38
3.2 Jenis Data.....	39
3.3 Metode Pengumpulan Data.....	39
3.4 Populasi dan Sampel.....	40
3.5 Variabel Penelitian.....	42
3.6 Metode Analisis Data.....	43
3.6.1 Uji Deskriptif.....	43
3.6.2 Uji Normalitas.....	46
3.6.3 Uji Hipotesis.....	47
IV. ANALISIS DAN PEMBAHASAN	
4.1 Hasil Analisis Uji Deskriptif Statistik.....	48
4.2 Hasil Analisis Uji Normalitas.....	49

4.3 <i>Return Saham, Return Pasar, dan Abnormal Return</i>	52
4.4 <i>Trading Volume Activity</i>	54
4.5 Pengujian Hipotesis.....	55
4.6 Pembahasan.....	58
4.6.1 Pembahasan Hipotesis Pertama.....	58
4.6.2 Pembahasan Hipotesis Kedua.....	59
V. KESIMPULAN DAN SARAN	
5.1. Kesimpulan.....	61
5.2. Saran.....	62
DAFTAR PUSTAKA	
LAMPIRAN	