

DAFTAR ISI

	Halaman
DAFTAR ISI	i
DAFTAR TABEL	iv
DAFTAR GAMBAR	vi
I. PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	7
1.3 Tujuan Penelitian	8
1.4 Manfaat Penelitian	8
II. TINJAUAN PUSTAKA	9
2.1 Pasar modal	9
2.1.1 Pengertian Pasar Modal.....	9
2.1.2 Pasar Modal yang Efisien.....	10
2.2 Arti Penting Informasi.....	12
2.3 <i>Corporate Action</i>	13
2.4 Saham.....	14
2.4.1 Pengertian Saham.....	14
2.4.2 Jenis-Jenis Saham	15
2.4.3 Harga Saham	16
2.5 <i>Stock Split</i>	17
2.5.1 Pengertian <i>Stock Split</i>	17
2.5.2 Jenis <i>Stock Split</i>	18
2.5.3 Tujuan <i>Stock Split</i>	19
2.5.4 Manfaat <i>Stock split</i>	20
2.5.5 Teori <i>Stock split</i>	20
2.6 Likuiditas saham	22
2.7 <i>Abnormal Return</i> Saham	23
2.8 Volume Perdagangan Saham	26
2.9 Volatilitas Harga Saham	27
2.10 Penelitian Terdahulu	28
2.11 Batasan Penelitian	32
2.12 Kerangka Pemikiran.....	32
2.13 Hipotesis.....	35
III. METODE PENELITIAN	37
3.1 Jenis Penelitian	37
3.2 Jenis dan Sumber Data	37

3.3 Populasi dan Sampel	38
3.3.1 Populasi	38
3.3.2 Sampel	38
3.4 Teknik Pengumpulan Data	40
3.5 Definisi Konseptual	41
3.6 Definisi Operasional	42
3.7 Teknik Analisis Data	42
3.7.1 Statistik Deskriptif	43
3.7.2 Uji Normalitas	43
3.7.3 Uji Hipotesis	44
IV. HASIL DAN PEMBAHASAN	48
4.1 Gambaran Umum Perusahaan	48
4.1.1 PT Astra Internasional Tbk	48
4.1.2 PT Astra Otoparts Tbk	49
4.1.3 PT Bank Rakyat Indonesia (Persero) Tbk	50
4.1.4 PT Bank Tabungan Pensiunan Nasional Tbk	52
4.1.5 PT Charoen Pokphand Indonesia Tbk	53
4.1.6 PT Ciputra Development Tbk	55
4.1.7 PT Intiland Development Tbk	56
4.1.8 PT Darya-Variya Laboratoria Tbk	56
4.1.9 PT Indomobil Sukses Internasional Tbk	57
4.1.10 PT Intraco Penta Tbk	58
4.1.11 PT Jasuindo Tiga Perkasa Tbk	59
4.1.12 PT PP London Sumatra Indonesia	59
4.1.13 PT Malindo Feedmil Tbk	61
4.1.14 PT Capitalinc Investment Tbk	62
4.1.15 PT Petrosea Tbk	63
4.1.16 PT Surya Semesta Internusa Tbk	63
4.1.17 PT Tunas Redean Tbk	64
4.2 Hasil Analisis Statistik Deskriptif	65
4.2.1 Analisis Statistik Deskriptif <i>Abnormal Return</i> Saham	65
4.2.2 Analisis Statistik Deskriptif Volume Perdagangan Saham	67
4.2.3 Analisis Statistik Deskriptif Volatilitas Harga Saham	69
4.3 Uji Normalitas	71
4.3.1 Hasil Uji Normalitas <i>Abnormal Return</i> Saham	71
4.3.2 Hasil Uji Normalitas Volume Perdagangan Saham	73
4.3.3 Hasil Uji Normalitas Volatilitas Harga Saham	74
4.4 Uji Hipotesis	76
4.4.1 Hasil Uji Hipotesis <i>Abnormal Return</i> Saham, Volume Perdagangan Saham dan Volatilitas Harga Saham	76
4.4.2 Hasil Uji Hipotesis Rata-Rata <i>Abnormal Return</i> Saham, Volume Perdagangan Saham dan Volatilitas Harga Saham	79
4.5 Pembahasan	84
4.5.1 <i>Abnormal Return</i> Saham Sebelum dan Sesudah <i>Stock Split</i> ..	84
4.5.2 Volume Perdagangan Saham Sebelum dan Sesudah <i>Stock Split</i>	88

4.5.3	Volatilitas Harga Saham Sebelum dan Sesudah <i>Stock Split</i>	91
V.	KESIMPULAN DAN SARAN	94
5.1	Kesimpulan	94
5.2	Saran.....	95

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN