

DAFTAR ISI

	Halaman
DAFTAR ISI	i
DAFTAR TABEL	iii
DAFTAR LAMPIRAN	vi
BAB I PENDAHULUAN	
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Perumusan Masalah	6
1.3. Batasan Masalah Penelitian	7
1.4. Tujuan Penelitian dan Manfaat Penelitian	8
1.4.1 Tujuan Penelitian	8
1.4.2 Manfaat Penelitian	8
BAB II KAJIAN PUSTAKA	
2.1. Landasan Teori	10
2.1.1. Pasar Modal	10
2.1.2. <i>Stock Split</i>	12
2.1.3. <i>Signaling Theory</i>	13
2.1.4. <i>Trading Range Theory</i>	15
2.1.5. Likuiditas Saham	16
2.1.6. Kinerja Saham Perusahaan	18
A. Perbedaan Likuiditas Saham Sebelum dan Sesudah <i>Stock Split</i>	18
B. Perbedaan Kinerja Saham Perusahaan Sebelum dan Sesudah <i>Stock Split</i>	19
2.1.8. Pengembangan Penelitian	20
2.2. Hipotesis	21
BAB III METODE PENELITIAN	
3.1. Populasi dan Sampel	25
3.2. Teknik Pengumpulan Sampel	26
3.3. Jenis Data dan Sumber Data	27
3.4. Definisi Operasional Variabel	28
A. <i>Stock Split</i>	28
B. Likuiditas Saham	29

1. Volume Perdagangan Saham	29
2. Volatilitas Harga Saham	29
C. Kinerja Perusahaan	30
3.5. Alat Analisis Data	30
3.5.1. Uji Beda Rata-Rata	30
BAB IV ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN	
4.1. Analisis Deskriptif	34
4.1.1. Volume Perdagangan Saham	34
4.1.2. Volatilitas Harga Saham	36
4.1.3. <i>Price Earnings Ratio</i> (PER)	38
4.2. Uji Normalitas	39
4.3. Pengujian Hipotesis	41
4.3.1. Pengujian Hipotesis Pertama	41
4.3.2. Pengujian Hipotesis Kedua.....	43
4.3.3. Pengujian Hipotesis Ketiga	45
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	
5.1 Kesimpulan	48
5.2 Keterbatasan	50
5.3 Saran	50

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 3.1 Proses Pengambilan Sampel	26
Tabel 3.2 Sampel Perusahaan Yang Melakukan <i>Stock Split</i>	27
Tabel 4.1 Volume Perdagangan Saham Sebelum dan Setelah <i>Stock Split</i> Tahun 2007-2009	34
Tabel 4.2 <i>Deskriptive Statistics</i> Volume Perdagangan Saham	35
Tabel 4.3 Volatilitas Harga Saham Sebelum dan Setelah <i>Stock Split</i> Tahun 2007-2009	36
Tabel 4.4 <i>Deskriptive Statistics</i> Volatilitas Harga Saham	37
Tabel 4.5 <i>Price Earnings Ratio</i> (PER) Sebelum dan Setelah <i>Stock Split</i> Tahun 2007-2009	38
Tabel 4.6 <i>Deskriptive Statistics Price Earnings Ratio</i>	39
Tabel 4.7 Hasil Uji Statistik <i>non parametrik Kolmogorov Smirnov</i>	40
Tabel 4.8 Hasil Pengujian Volume Perdagangan Sebelum dan Setelah Peristiwa <i>Stock Split</i> Menggunakan Alat Analisis <i>Non Parametrik</i> <i>Wilcoxon Sign Rank Test</i>	41
Tabel 4.9 Hasil Pengujian Volatilitas Sebelum dan Setelah Peristiwa <i>Stock Split</i> Menggunakan Alat Analisis <i>Non Parametrik</i> <i>Wilcoxon Sign Rank Test</i>	44
Tabel 4.10 Hasil Pengujian PER Sebelum dan Setelah Peristiwa <i>Stock Split</i> Menggunakan Alat Analisis <i>Non Parametrik Wilcoxon</i> <i>Sign Rank Test</i>	46

DAFTAR LAMPIRAN

- Lampiran I. Daftar Sampel Perusahaan yang Melakukan *Stock Split* 2007-2009
- Lampiran II. Data Volume Saham yang Diperdagangkan Perusahaan yang Melakukan *Stock Split* 2007-2009 pada *Event Period* (5 hari sebelum, 1 hari peristiwa, 5 hari setelah)
- Lampiran III. Data Jumlah Saham yang Beredar pada Perusahaan yang Melakukan *Stock Split* 2007-2009 pada *Event Period* (5 hari sebelum, 1 hari peristiwa, 5 hari setelah)
- Lampiran IV. Daftar Harga Saham Perusahaan yang Melakukan *Stock Split* 2007-2009 pada *Event Period* (5 hari sebelum, 1 hari peristiwa, 5 hari setelah)
- Lampiran V. Data PER Perusahaan Sampel pada *Event Period* (2 tahun sebelum, 1 tahun peristiwa, 2 tahun setelah) untuk Perusahaan yang Melakukan *Stock Split* 2007-2009
- Lampiran VI. Hasil Pengujian Normalitas Data menggunakan alat uji *Kolmogorov-Smirnov* (uji K-S)
- Lampiran VII. Hasil Pengujian Hipotesis 1 menggunakan alat uji *Wilcoxon Sign Rank Test*
- Lampiran VIII. Hasil Pengujian Hipotesis 2 menggunakan alat uji *Wilcoxon Sign Rank Test*
- Lampiran IX. Hasil Pengujian Hipotesis 3 menggunakan alat uji *Wilcoxon Sign Rank Test*