

DAFTAR ISI

ABSTRAK.....	i
ABSTRACT	ii
KATA PENGANTAR	iii
UCAPAN TERIMA KASIH	iv
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii

BAB I PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang Penelitian	1
1.2 Identifikasi Masalah	10
1.3 Rumusan Masalah	11
1.4 Tujuan Penelitian	11
1.5 Kegunaan Penelitian.....	12

BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS

2.1 Kajian Pustaka.....	13
2.1.1 Konsep <i>Stock Split</i>	18
2.1.1.1 Pengertian <i>Stock Split</i>	20
2.1.1.2 Alasan dan Tujuan <i>Stock Split</i>	22
2.1.1.3 Jenis-Jenis <i>Stock Split</i>	26
2.1.1.4 Manfaat <i>Stock Split</i>	28
2.1.1.5 Proses <i>Stock Split</i>	29
2.1.1.6 Hipotesa Pasar Efisien	31
2.1.2 Konsep Volume Perdagangan Saham	34
2.1.2.1 Pengertian Saham	34
2.1.2.2 Pengertian Likuiditas Saham	37
2.1.2.3 Pengertian Volume Perdagangan Saham.....	39

2.1.3 Konsep <i>Abnormal Return</i>	41
2.1.3.1 Pengertian <i>Return Saham</i>	41
2.1.3.2 Pengertian <i>Abnormal Return Saham</i>	44
2.1.4 Pola Hubungan <i>Stock Split</i> Dengan Volume Perdagangan Saham dan <i>Abnormal Return</i>	48
2.1.5 Orisinalitas Penelitian	50
2.2 Kerangka Pemikiran	53
2.3 Hipotesis.....	57

BAB III OBJEK DAN METODE PENELITIAN

3.1 Objek Penelitian	58
3.2 Metode Penelitian.....	58
3.2.1 Jenis Penelitian dan Metode yang Digunakan	58
3.2.2 Operasionalisasi Variabel	59
3.2.3 Jenis dan Sumber Data	61
3.2.4 Populasi, Sampel, dan Teknik Sampel.....	62
3.2.4.1 Populasi	62
3.2.4.2 Sampel	62
3.2.4.3 Teknik Sampel.....	63
3.2.5 Teknik Pengumpulan Data.....	63
3.2.6 Teknik Analisis Data dan Uji Hipotesis	64
3.2.6.1 Teknik Analisis Data	64
3.2.6.2 Pengujian Hipotesis	68

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1 Profil Bursa Efek Indonesia	72
4.1.1 Sejarah Singkat BEI.....	72
4.1.2 Visi dan Misi BEI	73
4.2 Gambaran Umum Sampel Penelitian.....	73
4.3 Gambaran Volume Perdagangan Saham dan <i>Abnormal Return</i>	78

4.3.1 Gambaran Volume Perdagangan Saham	78
4.3.2 Gambaran <i>Abnormal Return</i>	81
4.4 Hasil Pengujian Statistik	84
4.4.1 Analisis Deskriptif	84
4.4.1.1 Analisis Deskriptif Volume Perdagangan Saham	85
4.4.1.2 Analisis Deskriptif <i>Abnormal Return</i>	86
4.4.2 Uji Normalitas	88
4.4.2.1 Uji Normalitas Volume Perdagangan Saham	88
4.4.2.2 Uji Normalitas <i>Abnormal Return</i>	89
4.5 Pengujian Hipotesis	90
4.5.1 Uji Hipotesis Volume Perdagangan Saham	90
4.5.2 Uji Hipotesis <i>Abnormal Return</i>	91
4.6 Pembahasan Hasil Penelitian	92
4.6.1 Gambaran Volume Perdagangan Saham	92
4.6.2 Gambaran <i>Abnormal Return</i>	93
4.7 Temuan dan Hasil Penelitian	94
4.7.1 Temuan dan Hasil Penelitian Bersifat Teoritis	94
4.7.2 Temuan dan Hasil Penelitian Bersifat Empiris	96
4.8 Implikasi Hasil Penelitian Terhadap Pengembangan Pendidikan Manajemen Bisnis	98
 BAB V KESIMPULAN DAN REKOMENDASI	
5.1 Kesimpulan	101
5.1 Rekomendasi	102
 DAFTAR PUSTAKA	104

LAMPIRAN

DAFTAR TABEL

No. Tabel	Judul Tabel	Halaman
1.1	Daftar Perbandingan Harga dan Volume Perdagangan Saham Beberapa Perusahaan di Tahun 2012.....	3
1.2	Rata-Rata Volume Perdagangan Saham Sebelum dan Sesudah <i>Stock Split</i> Tahun 2009.....	7
1.3	Rata-Rata <i>Abnormal Return</i> Saham Sebelum dan Sesudah <i>Stock Split</i> Tahun 2009.....	8
1.4	Daftar Emiten yang Melakukan <i>Stock Split</i> di Tahun 2010-2012.....	9
2.1	Resume Hasil Penelitian Terdahulu.....	50
3.1	Operasional Variabel	60
3.2	Sumber dan Jenis Data.....	61
4.1	Daftar Emiten yang Melakukan <i>Stock Split</i> di Tahun 2010-2012.....	74
4.2	Perhitungan Volume Perdagangan Saham 10 hari Sebelum dan Sesudah Pengumuman <i>Stock Split</i>	79
4.3	Volume Perdagangan Saham <i>Ex-Date</i>	81
4.4	Perhitungan <i>Abnormal Return</i> Saham 10 hari Sebelum dan Sesudah Pengumuman <i>Stock Split</i>	82
4.5	<i>Abnormal Return</i> Saham <i>Ex-Date</i>	83
4.6	Statistik Deskriptif Volume Perdagangan Saham Sebelum dan Sesudah Pengumuman <i>Stock Split</i>	85
4.7	Statistik Deskriptif <i>Abnormal Return</i> Saham Sebelum dan Sesudah Pengumuman <i>Stock Split</i>	86
4.8	Uji Normalitas Volume Perdagangan Saham.....	88
4.9	Uji Normalitas <i>Abnormal Return</i> Saham.....	89
4.10	Hasil Uji <i>Paired Sample Test</i> Volume Perdagangan Saham	90

4.11	Hasil Uji <i>Paired Sample Test Abnormal Return</i> Saham.....	92
------	--	----

DAFTAR GAMBAR

No. Gambar	Judul Gambar	Halaman
2.1	Sistematika Prosedur Pelaksanaan <i>Stock Split</i>	30
2.2	Kerangka Pemikiran Analisis Volume Perdagangan Saham dan <i>Abnormal Return</i> Sebelum dan Sesudah <i>Stock Split</i> Periode 2010-2012.....	56
2.3	Paradigma Penelitian Analisis Volume Perdagangan Saham dan <i>Abnormal Return</i> Sebelum dan Sesudah <i>Stock Split</i> Periode 2010-2012.....	57

DAFTAR LAMPIRAN

Nomor	Nama Lampiran
Lampiran	
1.	Daftar sampel perusahaan yang melakukan <i>stock split</i> di BEI tahun 2010-2012
2.	Daftar volume yang diperdagangkan tiap emiten periode pengujian
3.	Volume saham yang beredar tiap emiten
4.	Daftar harga saham periode pengujian
5.	Daftar Index Harga Saham Gabungan (IHSG) periode pengujian
6.	Hasil perhitungan volume perdagangan saham 10 hari sebelum dan sesudah <i>stock split</i>
7.	Hasil perhitungan <i>return</i> saham individual 10 hari sebelum dan sesudah <i>stock split</i>
8.	Hasil perhitungan <i>expected return</i> (er) 10 hari sebelum dan sesudah <i>stock split</i>
9.	Hasil perhitungan <i>abnormal return</i> saham 10 hari sebelum dan sesudah <i>stock split</i>
10.	Hasil output spss 20.0 <i>for windows</i>
11.	Rekapitulasi bimbingan
12.	Berita acara perbaikan skripsi
13.	Daftar riwayat hidup