

## DAFTAR ISI

|  |    |
|--|----|
| <b>KATA PENGANTAR</b> .....                  | i  |
| <b>UCAPAN TERIMAKASIH</b> .....              | ii |
| <b>DAFTAR ISI</b> .....                      | vi |
| <b>DAFTAR TABEL</b> .....                    | ix |
| <b>DAFTAR GAMBAR / GRAFIK</b> .....          | x  |
| <b>BAB I PENDAHULUAN</b> .....               | 1  |
| 1.1 Latar Belakang Masalah .....             | 1  |
| 1.2 Rumusan Masalah .....                    | 10 |
| 1.3 Maksud dan Tujuan Penelitian .....       | 11 |
| 1.4 Kegunaan Penelitian .....                | 11 |
| <b>BAB II LANDASAN TEORI</b> .....           | 13 |
| 2.1 Pasar Modal di Indonesia .....           | 13 |
| 2.1.1 Sejarah Pasar Modal di Indonesia ..... | 13 |
| 2.1.2 Pengertian Pasar Modal .....           | 15 |
| 2.1.3 Peranan Pasar Modal .....              | 16 |
| 2.1.4 Instrumen Pasar Modal .....            | 16 |
| 2.1.5 Prosedur <i>Go Public</i> .....        | 18 |
| 2.2 Saham .....                              | 20 |

|  |           |
|--|-----------|
| 2.2.1 Pengertian Saham .....                                 | 20        |
| 2.2.2 Jenis-Jenis Saham .....                                | 21        |
| 2.2.3 <i>Return</i> Saham .....                              | 22        |
| 2.2.4 Teori Efisiensi Paasr Modal .....                      | 24        |
| 2.3 Pemecahan Saham ( <i>Stock Split</i> ) .....             | 28        |
| 2.4 Frekuensi Perdagangan Saham dan <i>Stock Split</i> ..... | 32        |
| 2.5 <i>Abnormal Return</i> .....                             | 33        |
| 2.6 Kerangka Pemikiran .....                                 | 35        |
| 2.7 Asumsi .....   | 44        |
| 2.8 Hipotesis .....  | 45        |
| <b>BAB III METODE PENELITIAN</b> .....                       | <b>47</b> |
| 3.1 Desain Penelitian .....                                  | 47        |
| 3.2 Operasionalisasi Variabel .....                          | 48        |
| 3.3 Populasi dan Sampel .....                                | 50        |
| 3.4 Teknik Pengumpulan Data .....                            | 56        |
| 3.5 Teknik Pengolahan Data dan Pengujian Hipotesis .....     | 57        |
| 3.5.1 Teknik Pengolahan Data .....                           | 57        |
| 3.5.2 Pengujian Hipotesis .....                              | 58        |
| <b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN</b> .....          | <b>60</b> |
| 4.1 Gambaran Objek Penelitian .....                          | 60        |
| 4.1.1 Deskripsi Data Variabel Penelitian .....               | 61        |

|  |           |
|--|-----------|
| 4.1.1.1 Data Frekuensi Perdagangan Saham .....     | 61        |
| 4.1.1.2 Data <i>Abnormal Return</i> .....          | 65        |
| 4.2 Deskripsi Hasil Penelitian .....               | 69        |
| 4.2.1 Uji Normalitas .....                         | 69        |
| 4.2.2 Teknik Regresi Linier Sederhana .....        | 74        |
| 4.3 Pengujian Hipotesis Penelitian .....           | 75        |
| 4.3.1 Frekuensi Perdagangan Saham .....            | 75        |
| 4.3.2 <i>Abnormal Return</i> .....                 | 78        |
| 4.4 Pembahasan Hasil Penelitian .....              | 80        |
| 4.4.1 Pembahasan Frekuensi Perdagangan Saham ..... | 80        |
| 4.4.2 Pembahasan <i>Abnormal Return</i> .....      | 84        |
| <b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN</b> .....            | <b>87</b> |
| 5.1 Kesimpulan .....                               | 87        |
| 5.2 Saran .....                                    | 88        |
| <b>DAFTAR PUSTAKA</b> .....                        | <b>89</b> |
| <b>LAMPIRAN-LAMPIRAN</b>                           |           |
| <b>DAFTAR RIWAYAT HIDUP</b>                        |           |