

## DAFTAR ISI

JUDUL .....	i
ABSTRAK.....	iii
LEMBAR PENGESAHAN.....	v
PERNYATAAN ORISINALITAS .....	vi
KATA PENGANTAR .....	vii
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR LAMPIRAN .....	xii
Daftar Tabel.....	xiii
Daftar Gambar.....	xiv
BAB I.....	1
PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang Penelitian.....	1
B. Rumusan Masalah.....	6
C. Tujuan Penelitian.....	7
D. Manfaat Penelitian.....	7
BAB II.....	8
KAJIAN TEORITIK.....	8
A. Kajian Pustaka.....	8
1. Stock Split.....	8
2. Teori yang Relevan.....	10
3. Abnomal Return.....	12
4. Likuiditas.....	13
5. Risiko saham.....	15
B. Hasil Penelitian yang Relevan.....	16
C. Kerangka Teoritik.....	25
D. Hipotesis .....	27
BAB III.....	29
METODOLOGI PENELITIAN .....	29
A. Objek dan Ruang Lingkup Penelitian.....	29

1. Objek Penelitian.....	29
2. Periode Penelitian.....	29
B. Metode Penelitian.....	29
C. Operasionalisasi Variable penelitian.....	30
1. Stock Split.....	30
2. Abnormal Return.....	31
3. Likuiditas.....	32
4. Risiko Saham.....	33
D. Metode Pengumpulan Data.....	34
E. Teknik Penentuan Populasi dan Sampel.....	34
F. Metode Analisis.....	36
1. Statistik Deskriptif.....	36
2. Uji Normalitas Data.....	36
3. Uji Hipotesis.....	37
BAB IV.....	39
HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	39
A. Deskriptif Data.....	39
1. Analisis Deskriptif Variabel <i>Abnormal Return</i> .....	40
2. Analisis Deskriptif Variabel Likuiditas Saham.....	40
3. Analisis Deskriptif Variabel Risiko Saham.....	41
B. Pengujian Hipotesis.....	42
1. Uji Normalitas.....	42
2. Pengujian Hipotesis.....	44
C. Pembahasan.....	48
BAB V.....	52
KESIMPULAN DAN SARAN.....	52
A. Kesimpulan.....	52
B. Saran.....	53
DAFTAR PUSTAKA.....	55
LAMPIRAN.....	57
RIWAYAT HIDUP.....	64

## DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran :	Judul	Halaman
1.	Daftar Perusahaan .....	57
2.	Data Stock Split .....	58
3.	Statistik Deskriptif .....	59
4.	Hasil Uji Normalitas .....	60
5.	Hasil Uji Beda Abnormal Return .....	61
6.	Hasil Uji Beda Bid – Ask Spread .....	62
7.	Hasil Uji Beda Risiko Saham .....	63

## Daftar Tabel

Tabel	Judul	Halaman
2.1	Matriks Penelitian Terdahulu .....	23
3.1	Operasional Variabel .....	33
3.2	Proses Pengambilan Sampel .....	35
4.1	Statistik Deskriptif .....	39
4.2	Hasil Uji Normalitas .....	43
4.3	Hasil Uji Beda <i>Abnormal Return</i> Sebelum dan Sesudah <i>Stock Split</i> .....	45
4.4	Hasil Uji Beda <i>Bid-Ask Spread</i> Sebelum dan Sesudah <i>Stock Split</i> .....	46
4.5	Hasil Uji Beda Risiko Saham Sebelum dan Sesudah <i>Stock Split</i> .....	47

## Daftar Gambar

Tabel	Judul	Halaman
2.1	Metode Penelitian .....	