

DAFTAR ISI

Halaman Judul	i
Lembar Pengesahan	ii
Pernyataan Orisinalitas	iii
Abstrak	iv
<i>Abstract</i>	v
Kata Pengantar	vi
Daftar Isi	ix
Daftar Tabel	xii
Daftar Lampiran	xiii
Daftar Gambar	xiv
Bab 1 Pendahuluan	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	9
1.3 Tujuan Penelitian	9
1.4 Manfaat Penelitian	10
Bab 2 Kajian Pustaka, Kerangka Pemikiran, dan Hipotesis	11
2.1 Kajian Pustaka	11
2.1.1 Pasar Modal	11
2.1.1.1 Jenis Pasar Modal	13
2.1.1.2 Efisiensi Pasar Modal	14
2.1.1.3 Tingkat Efisiensi Pasar Modal	15
2.1.2 Saham	16

2.1.2.1 Jenis- Jenis Saham	16
2.1.3 <i>Stock Split</i>	19
2.1.3.1 Teori Motivasi <i>Stock Split</i>	21
2.1.4 Harga Saham	22
2.1.5 Likuiditas Saham	24
2.1.6 <i>Abnormal Return</i> Saham.....	26
2.1.7 <i>Event Study</i>	29
2.2 Penelitian Terdahulu	30
2.3 Kerangka Penelitian	38
2.4 Hipotesis.....	39
Bab 3 Metodologi Penelitian	40
3.1 Objek dan Ruang Lingkup Penelitian	40
3.1.1 Objek Penelitian	40
3.1.2 Periode Penelitian.....	40
3.2 Metode Penelitian	40
3.3 Operasionalisasi Variabel Penelitian	41
3.3.1 Harga Saham	42
3.3.2 Likuiditas Saham.....	42
3.3.3 <i>Abnormal Return</i> Saham.....	43
3.4 Metode Pengumpulan Data	45
3.5 Teknik Penentuan Populasi dan Sampel	46
3.6 Metode Analisis	48
3.6.1 Statistik Deskriptif	49

	3.6.2 Uji Normalitas	49
	3.6.3 Uji Beda	49
Bab 4	Hasil Penelitian dan Pembahasan.....	51
	4.1 Deskripsi Unit Analisis	51
	4.1.1 Statistik Deskriptif Harga Saham.....	51
	4.1.2 Statistik Deskriptif Likuiditas Saham	53
	4.1.3 Statistik Deskriptif <i>Abnormal Return</i> Saham.....	54
	4.2 Hasil Penelitian	56
	4.2.1 Uji Normalitas	56
	4.2.1.1 Uji Normalitas Harga Saham.....	56
	4.2.1.2 Uji Normalitas Likuiditas Saham	57
	4.2.1.3 Uji Normalitas <i>Abnormal Return</i> Saham.....	58
	4.2.2 Uji Beda	58
	4.2.2.1 Uji Beda <i>Wilcoxon Sign Rank Test</i>	59
Bab 5	Kesimpulan dan Saran	64
	5.1 Kesimpulan.....	64
	5.2 Saran	65

Daftar Pustaka

Lampiran

DAFTAR TABEL

Gambar	Judul	Halaman
Tabel 1.1	Nilai IHSG Periode 2010- 2014	1
Tabel 2.1	Matriks Penelitian Terdahulu	35
Tabel 3.1	Operasionalisasi Variabel	45
Tabel 3.2	Daftar Perusahaan yang Melakukan Kebijakan <i>Stock Split</i>	47
Tabel 4.1	Statistik Deskriptif Harga Saham	51
Tabel 4.2	Statistik Deskriptif Likuiditas Saham	53
Tabel 4.3	Statistik Deskriptif <i>Abnormal Return</i>	54
Tabel 4.4	Uji Normalitas Harga Saham.....	56
Tabel 4.5	Uji Normalitas Liuiditas Saham	57
Tabel 4.6	Uji Normalitas <i>Abnormal Return</i>	58
Tabel 4.7	Uji Beda Harga Saham	59
Tabel 4.8	Uji Beda Likuiditas Saham	61
Tabel 4.9	Uji Beda <i>Abnormal Return</i> Saham	62

DAFTAR GAMBAR

Gambar	Judul	Halaman
Gambar 2.1	Kerangka Pemikiran	39

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1	Data Seluruh Perusahaan yang Melakukan <i>Stock Split</i>
Lampiran 2	Data Penelitian Perusahaan yang Melakukan <i>Stock Split</i>
Lampiran 3	Data Harga Saham
Lampiran 4	Data <i>Bid- Ask</i>
Lampiran 5	Data Hasil <i>Spread</i> Saham
Lampiran 6	Data IHSG 2010- 2014
Lampiran 7	Data Hasil <i>Actual Return</i>
Lampiran 8	Data Hasil <i>Expected Return</i>
Lampiran 9	Data Hasil <i>Abnormal Return</i>