DAFTAR ISI

HALAMAN

Judul……..... i

Halaman Pengesahan..... ii

Halaman Pengesahan Kelulusan Ujian..... iii

Pernyataan Orisinalitas Skripsi..... iv

Abstraksi……..... v

Kata Pengantar……..... vi

Daftar Tabel……..... xi

Daftar Gambar……..... xii

Daftar Lampiran..... xiii

BAB I : PENDAHULUAN……..... 1

1.1. Latar Belakang Masalah……..... 1

1.2. Perumusan Masalah……..... 6

1.3. Tujuan Penelitian dan Kegunaan Penelitian……..... 7

1.3.1. Tujuan Penelitian..... 7

1.3.2. Kegunaan Penelitian..... 7

1.4. Sistematika Penulisan……..... 8

BAB II : TINJAUAN PUSTAKA……..... 10

2.1. Landasan Teori……..... 10

2.1.1. Pemecahan Saham..... 10

2.1.2. Teori Pemecahan Saham..... 11

2.1.3. Jenis Pemecahan Saham..... 12

2.1.4. Event Study (Studi Peristiwa)..... 13

2.1.5. Likuiditas Saham..... 14
2.1.6. Return Saham dan Abnormal Return..... 15
2.1.7. Pengaruh Pemecahan Saham Terhadap Volume Perdagangan..... 19
2.1.8. Pengaruh Pemecahan Saham Terhadap Return Saham..... 20
2.2. Penelitian Terdahulu……..... 21
2.3. Kerangka Pemikiran..... 24
2.4. Hipotesis..... 26
BAB III : METODOLOGI PENELITIAN……... 27
3.1. Variabel Penelitian dan Definisi Operasional……..... 27
3.2. Penentuan Sampel.....……..... 30
3.3. Jenis dan Sumber Data……..... 32
3.4. Metode Pengumpulan Data……..... 33
3.5. Metode Analisis……..... 33
BAB IV : HASIL DAN PEMBAHASAN..... 41
4.1. Deskripsi Obyek Penelitian..... 41
4.1.1. Sekilas Gambaran Mengenai BEI……..... 41
4.1.2. Profil Perusahaan Yang Dijadikan Sampel..... 42
4.2. Analisis Data..... 55
4.2.1. Analisis Aktivitas Volume Perdagangan Sebelum dan Sesudah Pemecahan Saham..... 55
4.2.2. Analisis Abnormal Return Sebelum dan Sesudah Pemecahan Saham..... 61
BAB V : PENUTUP……... 70
5.1. Kesimpulan……... 70

5.2. Keterbatasan Penelitian..... 71

5.3. Saran……..... 71

Daftar Pustaka……..... 73

Lampiran……..... 75

FEB UNDIP