

## DAFTAR ISI

Halaman Judul.....	i
Halaman Sampul Depan Skripsi.....	ii
Halaman Judul Skripsi.....	iii
Halaman Pernyataan Bebas Plagiarisme.....	iv
Halaman Pengesahan Skripsi.....	v
Halaman Pengesahan Ujian Skripsi.....	vi
Abstraks.....	vii
Halaman Motto.....	viii
Halaman Persembahan.....	ix
Kata Pengantar.....	x
Daftar Isi.....	xiv
Daftar Tabel.....	xvi
Daftar Lampiran.....	xvii
<b>BAB I PENDAHULUAN</b>	
1.1. Latar Belakang Masalah.....	1
1.2. Rumusan Masalah.....	4
1.3. Batasan Masalah.....	5
1.4. Tujuan Penelitian.....	5
1.5. Manfaat Penelitian.....	6
<b>BAB II KAJIAN PUSTAKA</b>	
2.1. Hasil Penelitian Terdahulu.....	7
2.2. Landasan Teori.....	9
2.2.1. <i>Stock Splits</i> .....	9
2.2.2. Reaksi Pasar terhadap <i>Stock Splits</i> .....	11
2.2.3. <i>Stock Splits</i> di BEJ.....	13
2.2.4. <i>Return Saham</i> .....	15
2.3. Perumusan Hipotesis.....	18
<b>BAB III METODE PENELITIAN</b>	
3.1. Data dan Penentuan Sampel.....	20

3.1.1. Data yang Diperlukan.....	20
3.1.2. Populasi dan Sampel.....	21
3.2. Identifikasi dan Pengukuran Variabel.....	22
3.2.1. <i>Return</i> Saham.....	22
3.2.2. <i>Return</i> Pasar.....	23
3.2.3. Beta Saham.....	23
3.2.4. <i>Expected Return</i> .....	24
3.2.5. <i>Abnormal Return</i> .....	24
3.2.6. Rata-Rata <i>Abnormal Return</i> .....	26
3.3. Pengujian Hipotesis.....	26
<b>BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN</b>	
4.1. Data Perusahaan.....	28
4.2. Pengujian Hipotesis.....	30
4.2.1. Pengujian Hipotesis terhadap <i>abnormal Return</i> .....	30
4.2.2. Pengujian Hipotesis terhadap TVA.....	33
4.3. Analisis Hasil Hipotesis.....	35
<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN</b>	
5.1. Kesimpulan.....	39
5.2. Keterbatasan Penelitian.....	41
5.3. Saran.....	41
DAFTAR PUSTAKA.....	43
Lampiran.....	45

## DAFTAR TABEL

Tabel

4.1. Deta Perusahaan <i>Stock Splits</i> .....	29
4.2. Daftar Rata-Rata <i>AR</i> untuk Perusahaan dengan <i>Earning</i> Meningkat.....	31
4.3. Rata-Rata <i>Abnormal Return</i> .....	32
4.4. Rata-Rata <i>Trading Volume Activity</i> .....	34

