

“ANALISIS PENGARUH STOCK SPLIT TERHADAP ABNORMAL
RETURN SAHAM DI BURSA EFEK JAKARTA”

SKRIPSI

Ditulis dan diajukan untuk memenuhi syarat ujian akhir guna memperoleh
gelar Sarjana Strata-I di Program Studi Manajemen, Fakultas Ekonomi,

Universitas Islam Indonesia



Oleh

Nama : Zaenal Ma'ruf

Nomor Mahasiswa : 01311621

Program Studi : Manajemen

Bidang Konsentrasi : Keuangan

UNIVERSITAS ISLAM INDONESIA

FAKULTAS EKONOMI

YOGYAKARTA

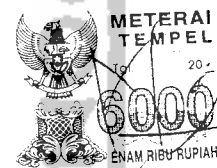
2005

PERNYATAAN BEBAS PLAGIARISME

“Dengan ini saya menyatakan bahwa dalam skripsi ini tidak terdapat karya yang pernah diajukan orang lain untuk memperoleh gelar kesarjanaan di suatu perguruan tinggi, dan sepanjang pengetahuan saya juga tidak terdapat karya atau pendapat yang pernah ditulis atau diterbitkan oleh orang lain, kecuali yang secara tertulis diacu dalam naskah ini dan disebutkan dalam referensi. Apabila kemudian hari terbukti bahwa pernyataan ini tidak benar, saya sanggup menerima hukuman/sanksi apapun sesuai peraturan yang berlaku.”

Yogyakarta, Juli 2005

Penulis



Zacnal Ma'ruf

“ANALISIS PENGARUH STOCK SPLIT TERHADAP ABNORMAL
RETURN SAHAM DI BURSA EFEK JAKARTA”



Nama : Zaenal Ma'ruf
Nomor Mahasiswa : 01311621
Program Studi : Manajemen
Bidang Konsentrasi : Keuangan

Yogyakarta, Juli 2005

Telah disetujui dan disahkan oleh

Dosen Pembimbing

A handwritten signature in black ink, appearing to be 'Abdul Moin', is written over the text 'Dosen Pembimbing'.

Abdul Moin, Drs, H, Mba.

BERITA ACARA UJIAN SKRIPSI

SKRIPSI BERJUDUL

**ANALISIS PENGARUH STOCK SPLIT TERHADAP ABNORMAL RETURN SAHAM
DI BURSA EFEK JAKARTA**

Disusun Oleh: **ZAENAL MA'RUF**
Nomor mahasiswa: 01311621

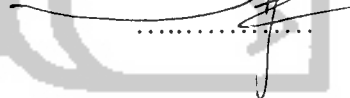
Telah dipertahankan di depan Tim Penguji dan dinyatakan **LULUS**
Pada tanggal : 13 Juli 2005

Penguji/Pemb. Skripsi: Drs. Abdul Moin, MBA

Penguji : Dra. Nurfauziah, MM



.....



.....



Mengetahui
Dekan Fakultas Ekonomi
Universitas Islam Indonesia



Drs. Suwarsono, MA

MODITO

“Pengetahuan Adalah Modalku, Akal Adalah Dasar Agamaku, Cinta Kasih Adalah Aliran Fihakku, Ingat Kepada ALI ALI Itulah Temanku, Kepributinan Itulah Kawanku, Kesabaran Adalah Bersamaku, Ilmu Adalah Senjataku, Berjihad Adalah Perangaiku, Dan Sholat Adalah Penawar Ulatiku.”

Al Hadits

“Kehidupan bukanlah jalan yang lurus dan mudah dilalui dimana kita bisa bepergian bebas tanpa halangan, namun berupa jalan-jalan sempit yang menyesatkan, dimana kita harus mencari jalan, tersesat dan bingung, sekarang dan sekali lagi kita sampai pada jalan tak berujung. Namun jika kita punya keyakinan, pintu pasti akan dibukakan untuk kita, mungkin bukanlah pintu yang selalu kita inginkan, namun pintu yang akhirnya akan terbukti terbaik untuk kita”.

A.J Cronin

“Kesuksesan bukan suatu kebetulan, tapi memerlukan persiapan yang matang, kerja keras, dan niat baik. Kalau menghadapi kesulitan, hadapi, lawan. Karena itu salah satu pintu keberhasilan. Kehidupan adalah sebuah lingkaran rantai, satu dengan yang lain saling kait mengait. Memberi dan diberi, membutuhkan dan dibutuhkan, menolong dan ditolong. Itulah takdir alam yang diciptakan Tuhan, dan orang-orang gagal yang mampu menerima kegagalannya dengan kepala tegak dan siap bangkit lagi dengan belajar dan berusaha adalah mereka yang siap menjadi dewasa dan sukses secara utuh”.

Andrie Wongso

KATA PENGANTAR

Bismillahirrohmanirrohiim

Assalamu'alaikum Wr. Wb.

Segala puji dan syukur penulis panjatkan kehadirat Allah SWT atas segala limpahan rahmat dan hidayah- Nya, sehingga penulis berhasil menyelesaikan skripsi yang berjudul : **“ANALISIS PENGARUH STOCK SPLIT TERHADAP ABNORMAL RETURN SAHAM DI BURSA EFEK JAKARTA”**. Skripsi ini dibuat guna memenuhi salah satu syarat untuk memperoleh gelar Sarjana Ekonomi Jurusan Manajemen pada Fakultas Ekonomi Universitas Islam Indonesia.

Dalam penyusunan skripsi ini, penulis banyak mendapatkan bantuan berupa dorongan, kritikan dan masukan yang membangun dari berbagai pihak. Oleh karena itu, penulis mengucapkan terima kasih yang sebesar-besarnya kepada pihak-pihak berikut ini :

1. Bapak Suwarsono Muhammad, MA., selaku Dekan Fakultas Ekonomi Universitas Islam Indonesia, yang telah memberi izin kepada penulis untuk menyusun skripsi.
2. Bapak Abdul Moin, Drs.H,MBA., selaku Dosen Pembimbing Skripsi, yang telah meberikan bimbingan, petunjuk dan pengarahan dari awal sampai terselesaikannya penyusunan skripsi ini.
3. Segenap dosen dan karyawan Fakultas Ekonomi UII yang telah mengajarkan segala ilmu pengetahuan yang sangat berharga bagi diriku.

4. Bapak dan Ibuku tercinta yang telah mencurahkan kasih sayangnya dan atas segala nasehat yang telah diberikan, kasih sayang kalian tidak bisa dibayar dengan apapun di dunia ini, semoga Allah SWT selalu melimpahkan rahmatnya kepada hamba-hamba-Nya.
5. Aa' Ridwan, Mbak Mardiana, Mbak Yuli tercinta yang telah memberi pelajaran berharga tentang kehidupan ini.
6. Teman-teman seperjuangan selama kuliah : Andika and Muhay yang telah bersedia menjadi teman sejati di Jogja ini, semoga kesuksesan selalu menyertai kalian.
7. Ade' Ika yang imoet, karena senyumanmulah dunia ini bisa lebih berwarna dan bermakna, terima kasih telah memberi dorongan dan semangat. I'll Miss You.
8. Anak-anak KOPMA FE UH periode 2003-2004 dan khususnya periode 2004-2005, yang telah memberi kenangan dan pengalaman yang sangat berharga bagi diriku ini.
9. Anak-anak KKN PRINGTALI : Moeti, Yuli, Retno, Anita, Siti, Mas AJ, yang telah mengisi hari-hariku selama di lokasi KKN yang tak mungkin aku lupakan sampai akhir hayatku.
10. Anak-anak Kost Karang Nongko no. 112 : Mas Andrie (Clas Mild) yang telah membimbing dalam beragama yang bener, Bang Ari 'Bali' yang mengajarkan cara merayu wanita, Bang Jhon Tito yang suka mancing gitu loh, Susanto (bogor) yang sok cool and seneng bikin geger kost, Prasetyo (bejo) yang bikin shock semua penghuni kost, Isa (wajah sangar

tapi kalem banget), Eko kodok yang scrabutan and funky abiss, and Mr. Roni thanks to bantuan komputernya.

11. Ibu dan bapak kost beserta keluarga yang telah memberi tumpangan selama di Jogja tercinta ini, khususnya Melin ta' tunggu 10 tahun lagi yooo.....

12. My Komputer, Radio Tape, and Motor SUPRA "X" ku yang selalu setia setiap saat dikala aku perlukan.

Serta semua pihak yang tak bisa disebutkan yang telah membantu atas terselesaikannya skripsi ini, terima kasih atas bantuan yang telah diberikan semoga Allah SWT memberikan balasan atas segala amal dan kebaikan, Amien. Akhirnya penulis berharap, semoga skripsi ini bermanfaat bagi kita semua dan menambah khasanah ilmu pengetahuan.

Wassalamu'alaikum Wr. Wb.

Yogyakarta, Juli 2005



UNIVERSITAS ISLAM INDONESIA

Penulis