

DAFTAR ISI

	Halaman
Halaman Judul Skripsi.....	i
Halaman Pernyataan Bebas Plagiarisme.....	ii
Halaman Pengesahaan Skripsi.....	iii
Halaman Pengesahaan Ujian Skripsi.....	iv
Halaman Persembahan	v
Motto	vi
Kata Pengantar	vii
Abstrak	x
Daftar Isi.....	xii
Daftar Tabel.....	xiv
Daftar Lampiran.....	xv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	7
1.3 Batasan Masalah.....	7
1.4 Tujuan Penelitian.....	8
1.5 Manfaat Penelitian.....	8
BAB II KAJIAN PUSTAKA.....	10
2.1 Hasil Penelitian Terdahulu.....	10
2.2 Landasan Teori.....	11
2.2.1 Pasar Modal.....	11
2.2.1.1 Pengertian Pasar Modal.....	11
2.2.1.2 Alasan dibentuknya Pasar Modal.....	12
2.2.1.3 Fungsi Pasar Modal.....	13
2.2.2 Pasar Modal yang Efisien.....	14
2.2.2.1 Pengertian Pasar Modal Efisien.....	14
2.2.2.2 Bentuk Pasar Modal yang efisien.....	14

2.2.2.3	Studi Peristiwa (<i>Event Study</i>).....	18
2.2.3	Pemecahan Saham (<i>Stock Split</i>).....	19
2.2.3.1	Pengertian Stock Split	19
2.2.3.2	Reaksi Pasar terhadap Stock Split.....	23
2.2.4	Return Saham dan Abnormal Return.....	25
2.2.4.1	Return Saham.....	25
2.2.4.2	Return tidak normal (Abnormal Return).....	26
2.3	Hipotesis	27
BAB III	METODOLOGI PENELITIAN.....	28
3.1	Populasi Penelitian.....	28
3.2	Sampel dan Cara penarikan Sampel.....	28
3.3	Variabel Penelitian	29
3.4	Metode Analisis	29
3.4.1	Langkah – langkah analisis.....	30
3.4.2	Pengujian Hipotesis.....	31
BAB IV	ANALISIS DAN PEMBAHASAN.....	32
4.1	Analisis Data.....	32
4.1.1	Pengumpulan Data.....	32
4.1.2	Analisis Return Saham Perusahaan.....	33
4.1.3	Analisis Abnormal Return.....	37
4.2	Pengujian Hipotesis dan Pembahasan Hasil Pengujian.	41
BAB V	KESIMPULAN DAN SARAN.....	44
5.1	Kesimpulan.....	44
5.2	Saran.....	45

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

DAFTAR TABEL

Tabel	Halaman
4.1 <i>Paired sample t-test</i> rata - rata Return Saham Periode 2001-2003.....	40
4.2 <i>Paired sample t-test</i> rata - rata Abnormal Return Saham Periode 2001-2003.....	41



DAFTAR LAMPIRAN

- Lampiran 1 Daftar Nama perusahaan yang melakukan *Stock split* periode 2001 – 2003.
- Lampiran 2 Daftar perhitungan Return saham dan *Abnormal return* Saham tiap – tiap perusahaan.
- Lampiran 3 Uji *Rata – rata Return Saham* dengan menggunakan *Paired sample t-test* periode 2001 - 2003.
- Lampiran 4 Uji *Rata – rata Abnormal Return* dengan menggunakan *Paired sample t-test* periode 2001 - 2003.

