

DAFTAR ISI

	Halaman
Halaman Judul	i
Halaman Persetujuan Pembimbing	ii
Halaman Pengesahan	iii
Pernyataan Keaslian Karya	iv
Halaman Motto dan Persembahan	v
Abstraksi	vi
Kata Pengantar	vii
Daftar Isi	ix
Daftar Tabel	xi
Daftar Gambar	xii
BAB I. PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Perumusan Masalah	4
C. Hipotesis	4
D. Tujuan Penelitian	5
E. Manfaat Penelitian	5
F. Metode Penelitian	6
G. Sistematika Penulisan	9
BAB II. LANDASAN TEORI	10
A. Investasi	10
1. Pengertian Investasi	10
2. Tujuan Investasi	10
3. Tipe-Tipe Investasi Keuangan	11
B. Pasar Modal	11
1. Pengertian Pasar Modal	11
2. Tujuan Pasar Modal	13
3. Manfaat Pasar Modal	14
4. Jenis-Jenis Pasar Modal	16
5. Instrumen Pasar Modal	18
6. Efisiensi Pasar Modal	22
7. Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	24
C. Return dan Risiko	25
1. Pengertian dan Jenis-Jenis Return	25
2. Return Tidak Normal (<i>Abnormal Return</i>)	27
3. Pengertian dan Jenis-Jenis Risiko	28
4. Teori Portofolio	28
D. Pemecahan Saham (<i>Stock Split</i>)	29
1. Pengertian <i>Stock Split</i>	29
2. Tujuan <i>Stock Split</i>	30

3. Penelitian Mengenai <i>Stock Split</i>	31
E. Kebalikan Pemecahan Saham (<i>Reverse Stock Split</i>)	33
BAB III. METODE PENELITIAN.....	34
A. Jenis Penelitian	34
B. Ruang Lingkup Penelitian	34
C. Ukuran Populasi dan Teknik Pengambilan Sampel	34
D. Jenis Data Penelitian.....	36
E. Batasan Variabel Operasional	37
F. Teknik Analisis Data	40
BAB IV. ANALISIS DAN PEMBAHASAN	43
A. Analisis	43
1. Prosedur Analisis.....	43
2. Pengujian Normalitas	49
3. Pengujian Hipotesis.....	50
a. Pada Hari t-5	50
b. Pada Hari t-4	50
c. Pada Hari t-3	51
d. Pada Hari t-2	52
e. Pada Hari t-1	53
f. Pada Hari t0.....	54
g. Pada Hari t+1	55
h. Pada Hari t+2	55
i. Pada Hari t+3	56
j. Pada Hari t+4	57
k. Pada Hari t+5	58
B. Pembahasan	59
BAB V. SIMPULAN DAN SARAN.....	62
A. Simpulan.....	62
B. Saran	63

DAFTAR PUSTAKA
LAMPIRAN-LAMPIRAN

DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 3.1 Perusahaan-Perusahaan Yang Mengumumkan <i>Stock Split</i> Periode 1 Januari 2004 Sampai Dengan 31 Desember 2005.....	36
Tabel 4.1 Data Harga Saham dan IHSG Selama Periode Pengamatan	44
Tabel 4.2 <i>Return</i> Realisasi dan <i>Return</i> Indeks Pasar Selama Periode Pengamatan ...	46
Tabel 4.3 <i>Abnormal Return</i> Selama Periode Pengamatan	48
Tabel 4.4 Hasil Pengujian Normalitas Data.....	49
Tabel 4.5 Hasil Pengujian Hipotesis.....	59

DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 4.1 Kurva Distribusi t Pada Hari t-4	50
Gambar 4.2 Kurva Distribusi t Pada Hari t-3	51
Gambar 4.3 Kurva Distribusi t Pada Hari t-2	52
Gambar 4.4 Kurva Distribusi t Pada Hari t-1	53
Gambar 4.5 Kurva Distribusi t Pada Hari t0	54
Gambar 4.6 Kurva Distribusi t Pada Hari t+1	55
Gambar 4.7 Kurva Distribusi t Pada Hari t+3	56
Gambar 4.8 Kurva Distribusi t Pada Hari t+4	57
Gambar 4.9 Kurva Distribusi t Pada Hari t+5	58