

ABTRAKSI

Dewi Kristianti, "Pengaruh Pengumuman *Stock Split* Terhadap Harga Saham, *Return* Saham, dan Volume Perdagangan Saham Pada Perusahaan yang Terdaftar di bursa Efek Indonesia (BEI)". (Dibawah bimbingan Ibu Silvia Dewiyanti, S.E., M.Si., Ak.).

Pemecahan saham adalah salah satu aksi korporasi yang dilakukan perusahaan dengan tujuan mengatur kembali harga saham agar berada pada kisaran yang lebih likuid serta memberikan sinyal yang berkualitas pada investor. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui atau menguji dan melihat apakah pengumuman *stock split* mempengaruhi harga saham, *return* saham, dan volume perdagangan saham. Populasi dalam penelitian ini adalah semua perusahaan yang mempublikasikan *stock split* yang terdaftar di BEI. Perusahaan yang mempublikasikan *stock split* pada tahun 2006 sampai dengan tahun 2010 dijadikan sample yang diambil secara *purposive sampling*. Sampel yang didapat sebanyak 32 perusahaan yang memenuhi kriteria. Pengujian hipotesis ini dilakukan dengan menggunakan uji statistik *Paired-Sampel T Test* dengan signifikan 5 %. Namun sebelumnya, dilakukan uji normalitas data terlebih dahulu, yaitu dengan menggunakan *Kolmogorov-Smirnov Test*. Dari penelitian tersebut, dapat disimpulkan bahwa terdapat perbedaan yang signifikan antara periode sebelum pengumuman *stock split* dan sesudah pengumuman *stock split* terhadap harga saham, *return* saham, dan volume perdagangan saham.

Kata Kunci : *Stock Split*, Harga Saham, *Return* Saham, dan Volume Perdagangan Saham