

**PENGARUH STOCK SPLIT TERHADAP ABNORMAL RETURN DAN VOLUME  
PERDAGANGAN SAHAM PADA PERUSAHAAN YANG TERDAFTAR DI BURSA  
EFEK INDONESIA (BEI)  
PERIODE 2010-2012**

**ABSTRAKSI**

*Penelitian ini berjudul Pengaruh Stock Split Terhadap Abnormal Return dan Volume Perdagangan Saham Pada Perusahaan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode Tahun 2010-2012. Tujuan penelitian ini adalah untuk menganalisis perbedaan abnormal return dan volume perdagangan saham sebelum dan sesudah stock split. Metode analisis data yang digunakan dalam penelitian ini adalah Uji beda dua berpasangan menggunakan paired sample t test. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa diperoleh nilai probabilitas = 0,423 > Level of sig = 0,05, maka disimpulkan bahwa tidak ada perbedaan signifikan abnormal return sebelum dan setelah stock split. Perbedaan signifikan ditunjukkan oleh nilai probabilitas = 0,047 < level of sig = 0,05 pada pengujian rata-rata volume perdagangan saham sebelum dan setelah stock split.*

*Kata kunci : Stock split, Abnormal return, Volume perdagangan saham*

**PENGARUH STOCK SPLIT TERHADAP ABNORMAL RETURN DAN  
VOLUME PERDAGANGAN SAHAM PADA PERUSAHAAN YANG  
TERDAFTAR DI BURSA EFEK INDONESIA (BEI) PERIODE 2010-2012**

**Skripsi**



**Disusun Oleh :**

**UMIYATI**

**141060263**

**JURUSAN MANAJEMEN**

**FAKULTAS EKONOMI**

**UNIVERSITAS PEMBANGUNAN NASIONAL "VETERAN"**

**YOGYAKARTA**

**2013**

## MOTTO DAN PERSEMBAHAN

*“Hari ini saya tidak mau merasa takut, tidak mau takut gagal, tidak mau takut berbahagia untuk menikmati yang indah, untuk mencintai, dan meyakini bahwa yang saya cintai juga mencintai saya.”*

*(Sibyl F Patridge)*

*“Berusaha menjadi yang terbaik dan memberi yang terbaik dari diri kita untuk orang lain adalah “investasi” yang paling menguntungkan.”*

*(Do. Mahardika)*

*Alhamdulillah Rabbil Alamin*

*Segala Puji Syukur Kehadirat Allah SWT*

*Atas Segala Rahmat dan Hidayah-Nya*

*Dengan penuh rasa syukur, ku persembahkan karya kecil ini buat :*

- *Suamiku Tri Nurcahyo dan kedua anakku (Putri Mesyha A. & Abid Fadhil Aryan C.)*
- *Bapakku Suratjiyo & Ibuku Aminah beserta adikku Ristina*
- *Untuk teman-temanku yang tidak bisa saya sebut satu-satu terimakasih atas dukungannya & seluruh keluarga besarku. matur nuwun*

## KATA PENGANTAR

*Assalamu 'alaikum Wr. Wb.*

Dengan mengucapkan puji syukur kehadirat Allah SWT yang berkenan melimpahkan rahmat-Nya kepada penulis, sehingga penulis dapat menyelesaikan penulisan skripsi ini. Selama penulisan skripsi ini telah banyak penulis mendapatkan bantuan dari berbagai pihak yang sangat besar artinya. Oleh karena itu, pada kesempatan ini penulis mengucapkan banyak terima kasih kepada :

1. Didit Herlianto, Drs, M.Si, selaku Dosen Pembimbing I yang telah banyak membantu, membimbing dan mengarahkan kepada penulis sehingga terselesaikan skripsi ini.
2. Drs. Agus Sukarno, M.Si, selaku Dosen Pembimbing II yang begitu sabar dalam membimbing dan menasehati kepada penulis sehingga skripsi ini selesai.
3. Suamiku tercinta dan anak-anaku tersayang terimakasih atas segala dorongan dan bantuan yang tak pernah putus sehingga penulis dapat menyelesaikan skripsi ini.
4. Kepada Bapak dan Ibu yang tak pernah letih mendoakan dan memberi banyak bantuan, sehingga memotivasi penulis untuk menyelesaikan skripsi ini.

Penulis menyadari sepenuhnya bahwa skripsi ini banyak kekurangannya. Untuk itu segala kesalahan yang ada dapat dimaklumi serta segala kritik dan saran yang membangun sangat penulis harapkan. Akhir kata, penulis berharap semoga hasil karya ini dapat memberikan manfaat bagi pihak yang memerlukannya.

*Wassalamu'alaikum Wr. Wb.*

Yogyakarta, 15 Agustus 2013

Penulis

Umiyati

**PENGARUH STOCK SPLIT TERHADAP ABNORMAL RETURN DAN VOLUME  
PERDAGANGAN SAHAM PADA PERUSAHAAN YANG TERDAFTAR DI BURSA  
EFEK INDONESIA (BEI) PERIODE 2010-2012**

**Disusun oleh:**

**UMIYATI**  
**No. Mhs : 141060263**

**telah dipertahankan di depan Dewan Penguji**

**pada tanggal 30 Agustus 2013**

**dan dinyatakan telah memenuhi syarat untuk diterima.**

**Susunan Dewan Penguji**

**Ketua Penguji  
/ Pembimbing Utama I**

**Drs. Didit Herlianto, M.Si**

**Penguji  
/Pembimbing Utama II**

**Drs. Agus Sukarno, M.Si**

**Penguji**

**Dra. Sri Budiwati WS, M.Si**

**Penguji**

**Drs. Joko Sukendro, M.Si**

**Mengetahui  
UPN “Veteran” Yogyakarta  
Fakultas Ekonomi  
Jurusan Manajemen  
Ketua**

**Dr. Heru Tri Sutiono, M.Si**  
**NIP. 19640105 199003 1 004**