

**TERHADAP ABNORMAL RETURN
PADA PERUSAHAAN GO PUBLIC DI BEJ**

SKRIPSI

**Diajukan Guna Memenuhi Persyaratan Untuk memperoleh Gelar Sarjana
Pada Fakultas Ekonomi Program Studi Manajemen
Universitas Muhammadiyah Yogyakarta**



Oleh :

IKE KURNIANING FEBRUARINI

20000410138

**FAKULTAS EKONOMI
UNIVERSITAS MUHAMMADIYAH YOGYAKARTA**

2005

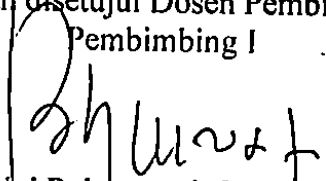
**TERHADAP ABNORMAL RETURN
PADA PERUSAHAAN GO PUBLIC DI BEJ**

Diajukan Oleh

IKE KURNIANING FEBRUARINI

20000410138

Telah disetujui Dosen Pembimbing
Pembimbing I


Alni Rahmawati, SE, M.M

NIK : 143026

Tanggal 16 Desember 2004

ANALISIS PENGARUH KANDUNGAN INFORMASI STOCK SPLIT
TERHADAP ABNORMAL RETURN
PADA PERUSAHAAN GO PUBLIC DI BEJ

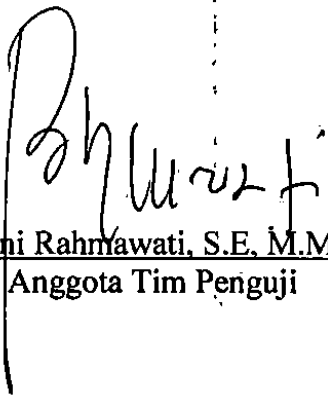
Diajukan Oleh

IKE KURNIANING FEBRUARINI
20000410138

Skripsi ini telah Dipertahankan dan Disahkan di depan
Dewan Penguji program Studi Manajemen Fakultas Ekonomi
Universitas Muhammadiyah Yogyakarta
Tanggal 26 Januari 2005
Yang terdiri dari



Drs. Gita Danupranata, M.M.
Ketua Tim Penguji

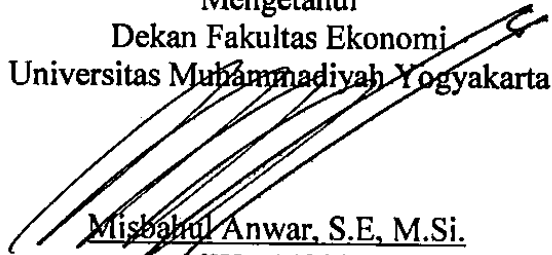


Alni Rahmawati, S.E, M.M.
Anggota Tim Penguji



Meika Kurnia Puji R. D. A, S.E, M.Si.
Anggota Tim Penguji

Mengetahui
Dekan Fakultas Ekonomi
Universitas Muhammadiyah Yogyakarta



Misbahul Anwar, S.E, M.Si.
NIK : 143014

KATA PENGANTAR

Bismillahirrahmannirrahim,

Assalamualaikum Wr. Wb

Dengan memanjatkan puji syukur kehadirat Allah SWT atas segala rahmat dan karunia-Nya, sehingga penyusun dapat menyelesaikan skripsi ini dengan baik. Tidak lupa shalawat serta salam semoga selalu tercurah kepada Nabi Muhammad SAW yang telah menunjukkan jalan terang benderang menggapai ridha-Nya.

Penyusunan skripsi dengan judul "**Analisis Pengaruh Kandungan Informasi *Stock Split* Terhadap *Abnormal Return* Pada Perusahaan *Go Public* Di BEJ**" ini dapat diselesaikan berkat bantuan yang diberikan oleh berbagai pihak, sehingga pada kesempatan ini penyusun mengucapkan terima kasih kepada:

1. Bapak Drs. Misbahul Anwar, Msi, selaku Pimpinan Fakultas Ekonomi Universitas Muhammadiyah Yogyakarta.
2. Ibu Alni Rahmawati, S.E, M.M, selaku Dosen Pembimbing dalam penyusunan skripsi ini.
3. Ibu Rini Juni Astuti, SE, Msi, selaku Dosen Pembimbing Akademik.
4. Bapak dan ibu tercinta yang telah memberikan bantuan materiil maupun spirituiil kepada penyusun sehingga dapat menyelesaikan skripsi ini dengan baik.
5. Novita Dwi Puspaningtyas, adeku tersayang terima kasih atas doa-doanya.

- dukungannya.
7. Ariel Peterpan, terima kasih atas lagu-lagunya.
 8. Teman-teman baikku, Phoejiama, Arie Muslimatul Girl, Lita Amalia Ilith, G-han Gembul, Ipeh Saripeh, terima kasih atas cinta kasih kalian.
 9. Sahabat-sahabat terkasihku, Novika, Ela, Ita, Noer, Ari, Re, terima kasih atas peristiwa-peristiwa manis yang pernah tercipta, kita tidak akan lupa.
 10. Semua pihak yang tidak dapat penyusun sebutkan satu persatu.

Semoga seluruh bantuan dan dukungan yang telah diberikan mendapatkan balasan dari Allah SWT.

Dan dengan keterbatasan yang ada penyusun menyadari skripsi ini masih jauh dari sempurna, oleh karena itu penyusun mengharapkan kritik dan saran yang membangun.

Akhir kata penyusun berharap semoga skripsi ini dapat bermanfaat bagi semua pihak.

Wassalamualaikum Wr. Wb.

Yogyakarta, November 2004

Penyusun

HALAMAN PERSETUJUAN DOSEN PEMBIMBING	ii
HALAMAN PENGESAHAN	iii
HALAMAN PERNYATAAN	iv
HALAMAN MOTTO	v
HALAMAN PERSEMBAHAN	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Rumusan Masalah	5
C. Tujuan Penelitian	5
D. Manfaat penelitian	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	7
A. Landasan Teori	7
B. Hasil Penelitian Terdahulu	26
C. Hipotesis	29
D. Model Penelitian	29
BAB III METODA PENELITIAN	31
A. Obyek penelitian	31
B. Teknik Pengambilan Sampel	31
C. Jenis Data	32
D. Teknik Pengumpulan Data	32
E. Definisi Operasional	33
F. Uji Hipotesis dan Analisis Data	35

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	42
A. Gambaran Umum Obyek Penelitian	42
B. Analisis Data	51
C. Analisis Regresi Linear Berganda	66
D. Uji Kevalidan Data (Uji Asumsi Klasik)	67
E. Hasil Penelitian (Uji Hipotesis)	69
BAB V SIMPULAN, SARAN dan KETERBATASAN	75
A. Kesimpulan	75
B. Saran	75
C. Keterbatasan	76
DAFTAR PUSTAKA	
LAMPIRAN	

4.2. <i>Abnormal Return</i>	51
4.3. Hasil Perhitungan <i>Spread</i>	55
4.4. Hasil Perhitungan <i>Trading Volume Activities</i>	59
4.5. Beta Saham Perusahaan	62
4.6. Hasil Regresi Linear Berganda	66
4.7. Durbin-Watson	68
4.8. Hasil Uji T	70
4.9. Hasil Uji F	72
4.10. Hasil Uji R^2	73