

***PENGARUH STOCK SPLIT TERHADAP ABNORMAL RETURN  
DAN VOLUME PERDAGANGAN SAHAM  
(Studi Pada Perusahaan yang terdaftar di BEI Tahun 2015-2019)***

**SKRIPSI**

Diajukan Sebagai Salah Satu Syarat Untuk Mencapai Gelar Sarjana Pada Program  
Studi S1 Jurusan Manajemen Intake DIII Fakultas Ekonomi dan Bisnis  
Universitas Andalas



**Dosen Pembimbing:**  
**Desyetti, SE., ME**

**PROGRAM STUDI S1 MANAJEMEN INTAKE DIII  
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS  
UNIVERSITAS ANDALAS  
PADANG  
2022**

## ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisa pengaruh *stock split* terhadap *abnormal return* dan volume perdagangan saham (studi pada perusahaan yang terdaftar di BEI tahun 2015-2019), dengan jumlah sampel yang didapat sebanyak 68 perusahaan yang melakukan *stock split*. Data yang digunakan dalam penelitian ini berjenis data sekunder yang bersumber dari situs [finance.yahoo.com](http://finance.yahoo.com) dan [idx.co.id](http://idx.co.id). Data-data tersebut akan diolah menjadi data *abnormal return* dan *trading volume activity*, kemudian dilakukan uji beda dengan menggunakan *paired sample t-test* untuk mengetahui ada tidaknya perbedaan *abnormal return* dan *trading volume activity* sepuluh hari sebelum dan sepuluh hari sesudah *stock split*. Hasil penelitian menunjukkan bahwa tidak terdapat perbedaan *abnormal return* saham sebelum dan sesudah *stock split* dan terdapat perbedaan *trading volume activity* pada sebelum dan sesudah perusahaan melakukan *stock split*. Dengan nilai signifikansi *abnormal return* sebesar  $0,138 > 0,05$ , sehingga dapat disimpulkan bahwa peristiwa *stock split* tidak berpengaruh signifikan terhadap *abnormal return* dan nilai signifikansi *trading volume activity* sebesar  $0,042 < 0,05$ , nilai keduanya berada dibawah  $0,05$ , sehingga dapat disimpulkan bahwa peristiwa *stock split* berpengaruh signifikan terhadap *trading volume activity*.

**Kata Kunci:** *Stock split, abnormal return, TVA*