

DAFTAR ISI

ABSTRAK	iii
ABSTRACT	iv
LEMBAR PERSETUJUAN PUBLIKASI	v
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	vi
PERNYATAAN BEBAS PLAGIAT	vii
LEMBAR MOTTO DAN PERSEMBAHAN	viii
KATA PENGANTAR.....	ix
DAFTAR ISI.....	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xiii
DAFTAR TABEL	xiv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Pertanyaan Penelitian	14
C. Tujuan Penelitian	14
D. Manfaat Penelitian	15
BAB II KAJIAN PUSTAKA.....	17
A. Teori Pendukung	17
1. <i>Efficient Market Hypotesis Theory</i>	17
2. Volatilitas Harga Saham.....	20
3. Volatilitas Laba	24
4. Leverage Keuangan	26
5. Kebijakan Dividen.....	28
6. <i>Price to Book Value</i>	29
B. Kerangka Teori dan Pengembangan Hipotesis	31
1. Penelitian Relevan	31
2. Kerangka Teoritik dan Hipotesis.....	47
3. Perumusan Hipotesis	53

BAB III METODE PENELITIAN	55
A. Unit Analisis, Populasi, Dan Sampel	55
1. Unit Analisis	55
2. Populasi	55
3. Sampel	55
B. Teknik Pengumpulan Data	57
C. Operasionalisasi Variabel	58
1. Variabel Terikat (<i>dependent variabel</i>)	58
2. Variabel Bebas (<i>independent variabel</i>)	59
D. Teknik Analisis	64
1. Analisis Statistik Deskriptif	64
2. Uji Asumsi Klasik	64
3. Analisis Regresi Linear Berganda	68
4. Uji Hipotesis	69
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	71
A. Statistik Deskriptif	71
B. Uji Asumsi Klasik	75
C. Analisis Regresi Linear Berganda	80
D. Uji Hipotesis	82
E. Pembahasan	86
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	96
A. Kesimpulan	96
B. Implikasi	98
C. Keterbatasan Penelitian	99
D. Rekomendasi Bagi Penelitian Selanjutnya	100
DAFTAR PUSTAKA	101
LAMPIRAN-LAMPIRAN	106
SURAT KETERANGAN HASIL PINDAI UJI KEMIRIPAN NASKAH ..	149
RIWAYAT HIDUP	150

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Harga Saham Indeks Kompas 100	5
Gambar 2.1 Kerangka Konseptual	53
Gambar 4.1 Hasil Uji Normal P-P Plot.....	77

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu yang Relevan	40
Tabel 3.1 Kriteria Pemilihan Sampel	56
Tabel 3.2 Kriteria Pengambilan Keputusan Uji Autokolerasi	67
Tabel 4.1 Statistik Deskriptif Variabel Penelitian.....	71
Tabel 4.2 Hasil Uji Normalitas	76
Tabel 4.3 Hasil Uji Multikolinearitas	78
Tabel 4.4 Hasil Uji Heteroskedastisitas	79
Tabel 4.5 Hasil Uji Autokolerasi	79
Tabel 4.6 Hasil Regresi Linear Berganda	80
Tabel 4.7 Hasil Uji T.....	82
Tabel 4.8 Hasil Uji F.....	85
Tabel 4.9 Hasil Uji Koefisien Determinasi	86

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1: Sampel Perusahaan	107
Lampiran 2: Kriteria Pemilihan Sampel	108
Lampiran 3: Data Variabel Sampel Perusahaan.....	115
Lampiran 4. Data Variabel Volatilitas Harga Saham	120
Lampiran 5. Data Variabel Volatilitas Laba	126
Lampiran 6. Data Variabel Leverage Keuangan.....	134
Lampiran 7. Data Variabel Kebijakan Dividen.....	139
Lampiran 8. Data Variabel <i>Price to Book Value</i>	144