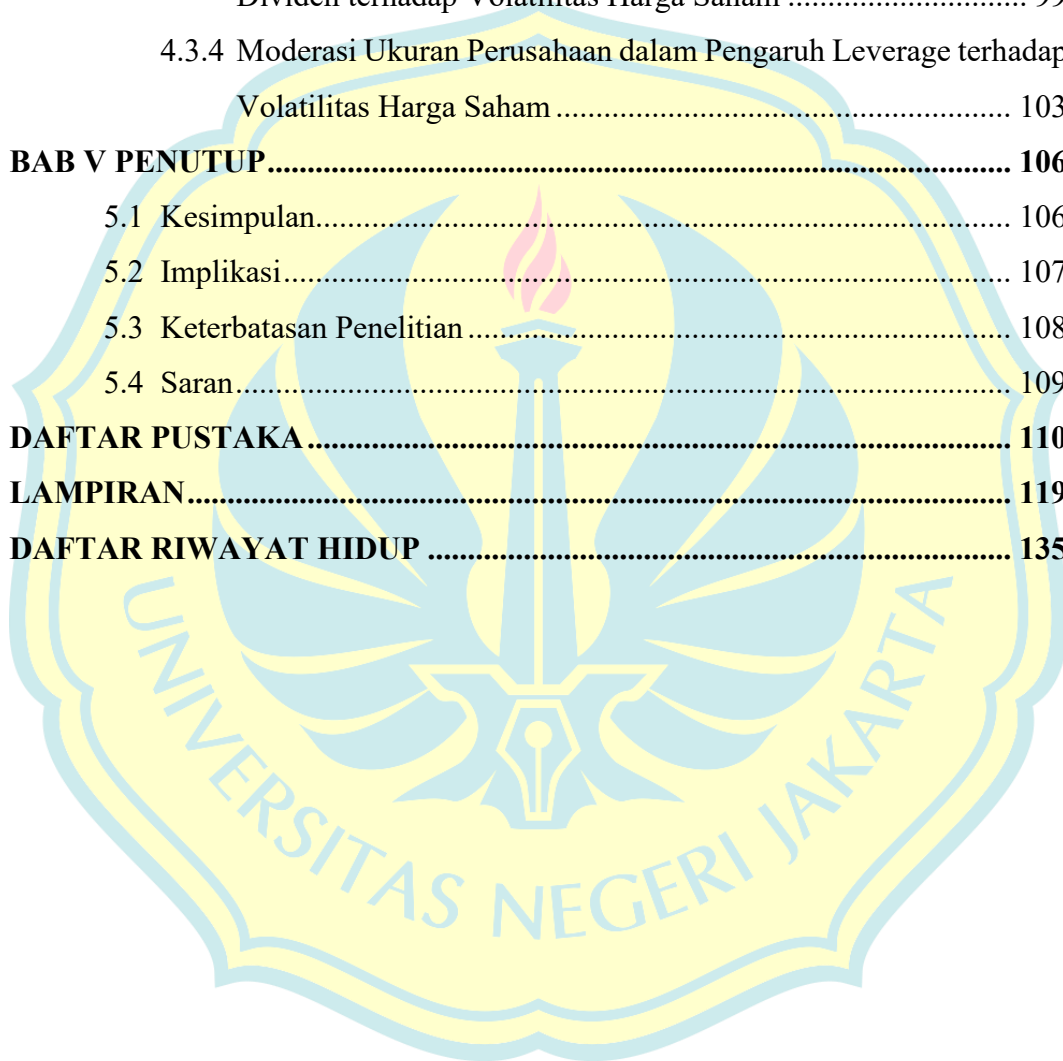


DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
ABSTRAK	iii
ABSTRACT	iv
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	v
LEMBAR PERNYATAAN ORISINALITAS	vi
LEMBAR PERSETUJUAN PUBLIKASI	vii
LEMBAR MOTTO DAN PERSEMBAHAN	viii
KATA PENGANTAR.....	ix
DAFTAR ISI.....	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xiv
DAFTAR TABEL	xv
DAFTAR LAMPIRAN	xvi
BAB I PENDAHULUAN.....	17
1.1 Latar Belakang	17
1.2 Rumusan Masalah	23
1.3 Tujuan Penelitian.....	23
1.4 Manfaat Penelitian.....	23
BAB II LANDASAN TEORI	25
2.1 Teori Pendukung	25
2.1.1 <i>Signaling Theory</i>	25
2.1.2 Volatilitas Harga Saham	26
2.1.3 Kebijakan Dividen	29
2.1.4 Leverage	31
2.1.5 Ukuran Perusahaan	34
2.2 Tinjauan Penelitian yang Relevan.....	35
2.3 Kerangka Teori dan Pengembangan Hipotesis	51
2.3.1 Kerangka Teori	51
2.3.2 Pengembangan Hipotesis.....	55
BAB III METODE PENELITIAN	56

3.1 Unit Analisis, Populasi, dan Sampel	56
3.1.1 Unit Analisis	56
3.1.2 Populasi.....	56
3.1.3 Sampel	57
3.2 Teknik Pengumpulan Data	59
3.2.1 Metode Penelitian	59
3.2.2 Konstelasi Hubungan antar Variabel	59
3.2.3 Pengumpulan Data	59
3.3 Operasional Variabel Penelitian.....	60
3.3.1 Variabel Dependen (Y).....	60
3.3.2 Variabel Independen (X)	61
3.3.3 Variabel Moderasi (Z)	62
3.4 Teknik Analisis Data	63
3.4.1 Analisis Statistika Deskriptif	64
3.4.2 Model Regresi Data Panel	64
3.4.3 Tahapan Analisis Data	65
3.4.4 Uji Asumsi Klasik.....	67
3.4.5 Analisis Regresi Linier Berganda.....	70
3.4.6 Uji Kelayakan Model.....	71
3.4.7 Moderating Regression Analysis (MRA)	72
BAB IV PEMBAHASAN.....	74
4.1 Deskripsi Objek Data Penelitian	74
4.2 Hasil Penelitian	74
4.2.1 Analisis Statistik Deskriptif.....	74
4.2.2 Uji Model Regresi.....	81
4.2.3 Uji Pemilihan Model.....	85
4.2.4 Uji Asumsi Klasik.....	86
4.2.5 Analisis Regresi Linier Berganda.....	89
4.2.6 Uji Hipotesis Penelitian	90
4.2.7 Uji Moderated Regression Analysis (MRA)	92
4.3 Pembahasan Hasil Penelitian	93

4.3.1 Pengaruh Kebijakan Dividen terhadap Volatilitas Harga Saham	93
4.3.2 Pengaruh Leverage terhadap Volatilitas Harga Saham	96
4.3.3 Moderasi Ukuran Perusahaan dalam Pengaruh Kebijakan Dividen terhadap Volatilitas Harga Saham	99
4.3.4 Moderasi Ukuran Perusahaan dalam Pengaruh Leverage terhadap Volatilitas Harga Saham	103
BAB V PENUTUP	106
5.1 Kesimpulan.....	106
5.2 Implikasi.....	107
5.3 Keterbatasan Penelitian	108
5.4 Saran.....	109
DAFTAR PUSTAKA.....	110
LAMPIRAN.....	119
DAFTAR RIWAYAT HIDUP	135



Intelligentia - Dignitas

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Teori.....	51
Gambar 3.1 Konstelasi Hubungan antar Variabel	59
Gambar 4.1 Grafik Histrogram Volatilitas Harga Saham.....	76
Gambar 4.2 Grafik Histrogram Kebijakan Dividen.....	78
Gambar 4.3 Grafik Histrogram <i>Leverage</i>	79
Gambar 4.4 Grafik Histrogram Ukuran Perusahaan	81
Gambar 4.5 Uji Normalitas	86



Intelligentia - Dignitas

DAFTAR TABEL

Tabel 3.1 Populasi Terjangkau.....	57
Tabel 4.1 Analisis Statistik Deskriptif	74
Tabel 4.2 Distribusi Frekuensi Volatilitas Harga Saham.....	76
Tabel 4.3 Distribusi Frekuensi Kebijakan Dividen.....	77
Tabel 4.4 Distribusi Frekuensi <i>Leverage</i>	79
Tabel 4.5 Distribusi Frekuensi Ukuran Perusahaan	80
Tabel 4.6 Uji <i>Common Effect Model</i>	81
Tabel 4.7 Uji <i>Fixed Effect Model</i>	83
Tabel 4.8 Uji <i>Random Effect Model</i>	84
Tabel 4.9 Uji Chow	85
Tabel 4.10 Uji Hausman	86
Tabel 4.11 Hasil Kesimpulan Pemilihan Model	86
Tabel 4.12 Uji Multikolinearitas	87
Tabel 4.13 Uji Heteroskedastisitas.....	88
Tabel 4.14 Uji Autokorelasi.....	88
Tabel 4.15 Hasil Pengujian Analisis Regresi Linier Berganda.....	89
Tabel 4.16 Uji <i>t</i>	90
Tabel 4.17 Uji <i>F</i>	91
Tabel 4.18 Uji R^2	92
Tabel 4.19 Ukuran Perusahaan Memoderasi Pengaruh Kebijakan Deviden terhadap Volatilitas Harga Saham.....	92
Tabel 4.20 Ukuran Perusahaan Memoderasi Pengaruh <i>Leverage</i> terhadap Volatilitas Harga Saham.....	93

Intelligentia - Dignitas

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 : Tabulasi Olah Data Penelitian	119
Lampiran 2 : Tabulasi Data Variabel Volatilitas Harga Saham (Y)	122
Lampiran 3 : Tabulasi Data Variabel Kebijakan Dividen (X1)	125
Lampiran 4 : Tabulasi Data Variabel <i>Leverage</i> (X2).....	128
Lampiran 5 : Tabulasi Data Variabel Ukuran Perusahaan (Z).....	131
Lampiran 6 : Hasil Turnitin	134



Intelligentia - Dignitas