

DAFTAR ISI

	Halaman
JUDUL	i
ABSTRAK	ii
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	iv
PERNYATAAN ORISIONALITAS	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Identifikasi Masalah	11
C. Pembatasan Masalah	12
D. Perumusan Masalah	12
E. Tujuan Penelitian	13
F. Manfaat Penelitian	13
BAB II KAJIAN TEORETIK	
A. Deskripsi Konseptual	16
1. Pasar Modal	16
2. Teori Sinyal (<i>Signaling Theory</i>).....	18
3. Teori Agensi (<i>Agency Theory</i>).....	18

4. Volume Perdagangan Saham	19
5. Laba Akuntansi	20
6. Arus Kas	21
7. <i>Return on equity</i>	25
8. Dividen	27
B. Hasil Penelitian yang Relevan	30
C. Kerangka Teoretik	33
D. Perumusan Hipotesis Penelitian.....	34

BAB III METODOLOGI PENELITIAN

A. Tujuan Penelitian	39
B. Objek dan Ruang Lingkup Penelitian	39
C. Metodologi Penelitian	40
D. Populasi dan Sampel	40
E. Operasionalisasi Variabel Penelitian	41
F. Teknik Analisis Data	46
1. Uji Asumsi Klasik.....	46
2. Analisis Regresi Linear Berganda.....	49
3. Uji Hipotesis secara Parsial (Uji Statistik t).....	51
4. Uji Statistik F	52

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

A. Deskripsi Konseptual	53
1. Pemilihan Sampel	53
2. Statistik Deskriptif	54

B. Pengujian Hipotesis	58
1. Hasil Uji Asumsi Klasik	58
2. Pengujian Model Regresi	64
3. Analisis Hasil Regresi Linear Berganda	69
4. Hasil Uji Hipotesis	72
C. Pembahasan	76
BAB V KESIMPULAN, IMPLIKASI, DAN SARAN	
A. Kesimpulan	86
B. Implikasi	87
C. Saran	89
DAFTAR PUSTAKA	90
LAMPIRAN	92
RIWAYAT HIDUP	131

DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar II.1 Kerangka Teoritik	34
Gambar IV.1 Hasil Uji Jarque-Bera	59

DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel II.1 Hasil Penelitian yang Relevan	30
Tabel IV.1 Hasil Pemilihan Sampel	54
Tabel IV.2 Statistik Deskriptif	55
Tabel IV.3 Hasil Uji Matriks Korelasi	60
Tabel IV.4 Hasil Perhitungan VIF.....	61
Tabel IV.5 Hasil Uji <i>Glesjer</i>	62
Tabel IV.6 Hasil Pengujian Durbin-Watson dengan Model REM	63
Tabel IV.7 Uji <i>Pooled OLS</i>	64
Tabel IV.8 Hasil <i>Fixed Effect Model</i>	66
Tabel IV.9 Hasil Uji <i>Chow Fixed Effec</i>	67
Tabel IV.10 Hasil <i>Random Effect Model</i>	68
Tabel IV.11 Hasil Hasil Uji Hausman Test	69
Tabel IV.12 Hasil Analisa Regresi Linera Berganda (REM)	70
Tabel IV.13 Hasil Uji Koefisien Determinasi	73
Tabel IV.14 Hasil Uji t	74
Tabel IV.15 Hasil Uji F	76

DAFTAR LAMPIRAN

	Halaman
Lampiran 1 Daftar Perusahaan Yang Menjadi Sampel	93
Lampiran 2 Data Variabel Dependen dan Independen	94
Lampiran 3 Perhitungan Volume Perdagangan Saham	97
Lampiran 4 Perhitungan Laba Akuntansi	101
Lampiran 5 Perhitungan Arus Kas	109
Lampiran 6 Perhitungan ROE	113
Lampiran 7 Data Variabel Yang Telah Dijadikan Logaritma Natural	117
Lampiran 8 Nilai Maksimum Volume Perdagangan Saham	120
Lampiran 9 Nilai Minimum Volume Perdagangan Saham.....	127
Lampiran 10 Nilai maksimum Laba Akuntansi.....	122
Lampiran 11 Nilai Minimum Laba Akuntansi.....	123
Lampiran 12 Nilai Maksimum Arus Kas.....	124
Lampiran 13 Nilai Minimum Arus Kas	125
Lampiran 14 Nilai Maksimum ROE.....	126
Lampiran 15 Nilai Minimum ROE.....	127
Lampiran 16 Nilai Maksimum Dividen.....	128