

DAFTAR ISI

ABSTRAK	i
LEMBAR PENGESAHAN	iii
LEMBAR ORISINILITAS	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR LAMPIRAN	xi
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii
BAB I.....	1
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Perumusan Masalah.....	8
C. Tujuan Penelitian.....	9
D. Kegunaan Penelitian.....	9
BAB II.....	11
A. Deskripsi Konseptual	11
1. Teori Signal (<i>Signalling Theory</i>)	11
2. Volatilitas Harga Saham	12
3. Volume Perdagangan Saham	18

4. Volatilitas laba	20
5. <i>Leverage</i>	22
6. Kebijakan Dividen	25
B. Hasil Penelitian yang Relevan.....	28
C. Kerangka Teoritik.....	37
D. Perumusan Hipotesis	40
BAB III	42
A. Objek dan Ruang Lingkup Penelitian	42
B. Metode Penelitian.....	42
C. Metode Penentuan Populasi dan Sampel.....	43
D. Operasionalisasi Variabel Penelitian.....	44
1. Variabel Terikat (<i>dependent variabel</i>).....	44
2. Variabel Bebas (<i>independent variabel</i>)	45
E. Teknik Analisis.....	48
1. Analisis Statistik Deskriptif	48
2. Uji Pemilihan Model.....	48
3. Uji Asumsi Klasik.....	52
4. Model Analisis.....	56
5. Uji Hipotesis	57
BAB IV	59

A. Deskripsi Data	59
1. Hasil Pemilihan Sampel.....	59
2. Analisis Statistik Deskriptif	59
B. Pengujian Hipotesis	64
1. Pemilihan Model Regresi.....	64
2. Uji Asumsi Klasik.....	65
C. Analisis Regresi Data Panel	68
D. Pengujian Hipotesis	70
1. Uji Signifikansi Parsial (Uji Statistik t)	71
2. Uji Koefisien Determinasi (R^2).....	73
E. Pembahasan	74
1. Pengaruh Volume Perdagangan Saham terhadap Volatilitas Harga Saham..	74
2. Pengaruh Volatilitas Laba terhadap Volatilitas Harga Saham.....	77
3. Pengaruh <i>Leverage</i> terhadap Volatilitas Harga Saham	80
4. Pengaruh Kebijakan Dividen terhadap Volatilitas Harga Saham	82
BAB V.....	86
A. Kesimpulan.....	86
B. Implikasi	87
C. Saran.....	88
DAFTAR PUSTAKA	90

Lampiran-Lampiran	95
RIWAYAT HIDUP.....	124

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Daftar Sampel Perusahaan Penelitian.....	96
Lampiran 2 Perhitungan Volatilitas Harga Saham	97
Lampiran 3 Perhitungan Volume Perdagangan Saham	100
Lampiran 4 Rekapitulasi Perhitungan Volatilitas Laba	103
Lampiran 5 Perhitungan Leverage	106
Lampiran 6 Perhitungan Kebijakan Dividen	109
Lampiran 7 Rekapitulasi Perhitungan Seluruh Variabel.....	112
Lampiran 8 Hasil Uji Statistik Deskriptif	115
Lampiran 9 Hasil Uji Chow	116
Lampiran 10 Hasil Uji Hausman	117
Lampiran 11 Hasil Pengujian Model Random Effect.....	118
Lampiran 12 Hasil Uji Multikolinieritas.....	119
Lampiran 13 Kartu Konsultasi.....	120

DAFTAR TABEL

Tabel IV. 1 Statistik Deskriptif	60
Tabel IV. 2 Hasil Uji Chow / Redundant Fixed effect.....	64
Tabel IV. 3 Hasil Uji Hausman / Hausman Test.....	65
Tabel IV. 4 Hasil Uji Multikolinieritas	67
Tabel IV. 5 Hasil Regresi Data Panel (<i>Cross Section Random Effect</i>).....	68
Tabel IV. 6 Hasil Uji Statistik t.....	71
Tabel IV. 7 Hasil Uji Koefisien Determinasi.....	73

DAFTAR GAMBAR

Gambar I. 1 Indeks Sektoral Perusahaan di Bursa Efek	3
Gambar II. 1 Kerangka Teoritik.....	40