

DAFTAR ISI

ABSTRAK	iii
<i>ABSTRACT</i>	iv
LEMBAR ORISINALITAS	v
LEMBAR PERSETUJUAN SIDANG SKRIPSI	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiv
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang.....	1
B. Rumusan Masalah.....	12
C. Tujuan Penelitian	12
D. Manfaat Penelitian	13
BAB II KAJIAN TEORETIK.....	15
A. Deskripsi Konseptual.....	15
1. Teori Sinyal (<i>Signalling Theory</i>)	15
2. Volatilitas Harga Saham	16
3. <i>Volatilitas Laba</i>	20

4. Kebijakan Dividen	23
5. <i>Leverage</i>	27
6. Pertumbuhan Aset	28
B. Hasil Penelitian yang Relevan	31
C. Kerangka Teoretik	43
D. Perumusan Hipotesis Penelitian.....	50
BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....	51
A. Objek dan Ruang Lingkup Penelitian	51
B. Metode Penelitian	51
C. Populasi dan Sampel	52
D. Operasionalisasi Variabel Penelitian	54
1. Variabel Dependen.....	54
2. Variabel Independen	55
E. Teknik Analisis Data	60
1. Statistik Deskriptif	60
2. Uji Pemilihan Model.....	61
3. Uji Asumsi Klasik.....	64
4. Model Analisis	68
5. Uji Hipotesis	68
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	72
A. Deskripsi Data.....	72

B. Pengujian Hipotesis	78
C. Analisis Regresi Data Panel.....	87
D. Pengujian Hipotesis	89
E. Pembahasan	93
BAB V KESIMPULAN, IMPLIKASI, DAN SARAN	110
A. Kesimpulan	110
B. Implikasi	111
C. Saran	113
DAFTAR PUSTAKA	114

DAFTAR TABEL

Tabel II.1 Hasil Penelitian yang Relevan.....	31
Tabel III.1 <i>Purposive Sampling</i> Penelitian	53
Tabel IV.1 Hasil Statistik Deskriptif	72
Tabel IV.2 Hasil <i>Uji Chow</i>	79
Tabel IV.3 Hasil <i>Uji Hausman</i>	80
Tabel IV.4 Hasil Uji <i>Lagrange Multiplier</i>	81
Tabel IV.5 Hasil Uji Normalitas	84
Tabel IV.6 Hasil Uji Autokorelasi	85
Tabel IV.7 Hasil Uji Heteroskedastisitas	86
Tabel IV.8 Hasil Uji Multikolinearitas	87
Tabel IV.9 Hasil Regresi Penelitian.....	88
Tabel IV.10 Hasil Uji t.....	90
Tabel IV.11 Hasil Uji F.....	92
Tabel IV.12 Hasil Uji Koefisien Determinasi	93
Tabel IV.13 Pembuktian Hipotesis 1	94
Tabel IV.14 Pembuktian Hipotesis 2	98
Tabel IV.15 Pembuktian Hipotesis 3	103
Tabel IV.16 Pembuktian Hipotesis 4	105

DAFTAR GAMBAR

Gambar I.1 Harga Saham Astra Berfluktuasi dari Periode ke Periode	6
Gambar I.2 Kinerja Astra International	7

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1: Daftar Sampel Perusahaan.....	120
Lampiran 2: Perhitungan Volatilitas Harga Saham	121
Lampiran 3: Perhitungan Volatilitas Laba	138
Lampiran 4: Perhitungan Kebijakan Dividen	140
Lampiran 5: Perhitungan <i>Leverage</i>	142
Lampiran 6: Perhitungan Pertumbuhan Aset	144
Lampiran 7: Rekapitulasi Perhitungan Seluruh Variabel.....	146
Lampiran 8: Hasil Uji Statistik Deskriptif	148
Lampiran 9: Hasil Uji Normalitas.....	149
Lampiran 10: Hasil Uji Chow	150
Lampiran 11: Hasil Uji Hausman	151
Lampiran 12: Hasil Uji <i>Lagrange Multiplier</i>	152
Lampiran 13: Hasil Uji Model Penelitian	153
Lampiran 14: Hasil Uji Normalitas Sebelum <i>Outlier</i>	154
Lampiran 15: Titik Ekstrim pada Uji Outlier.....	155
Lampiran 16: Kartu Konsultasi Bimbingan Skripsi.....	160