

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	ii
LEMBAR PERNYATAAN	iii
ABSTRACT	iv
ABSTRAK	v
KATA PENGANTAR	vi
UCAPAN TERIMA KASIH	vii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Penelitian	1
1.2 Permasalahan Penelitian.....	4
1.3 Tujuan dan Manfaat Penelitian	5
1.3.1 Tujuan Penelitian	5
1.3.2 Manfaat Penelitian	6
1.4 Sistematika Pembahasan	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	9
2.1 Model Penelitian Terdahulu.....	9
2.2 Landasan Teori.....	14
2.2.1 Teori Sinyal (<i>Signaling Theory</i>).....	14
2.2.2 Hipotesis Pasar Efisien (<i>Efficient Market Hypothesis</i>).....	15
2.2.2.1 Bentuk Lemah (<i>The Weak Form of EMH</i>).....	16
2.2.2.2 Bentuk Semi-kuat (<i>The semi-strong form of EMH</i>).....	16
2.2.2.3 Bentuk Kuat (<i>The strong form of EMH</i>)	17
2.3 Volatilitas Harga Saham	17
2.4 Hubungan Antar Variabel	19
2.4.1 Hubungan <i>Dividend Yield</i> dengan Volatilitas Harga Saham.....	19
2.4.2 Hubungan <i>Dividend Payout Ratio</i> dengan Volatilitas Harga Saham	21
2.4.3 Hubungan Ukuran Perusahaan dengan Volatilitas Harga Saham	22
2.4.4 Hubungan Pertumbuhan Aset dengan Volatilitas Harga Saham	23
2.4.5 Hubungan Leverage dengan Volatilitas Harga Saham	25
2.4.6 Hubungan Earning Per Share dengan Volatilitas Harga Saham.....	26
2.4.7 Hubungan Volatilitas Laba dengan Volatilitas Harga Saham.....	27
2.5 Model Penelitian	28

BAB III	METODE PENELITIAN	30
	3.1 Rancangan Penelitian	30
	3.2 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional	31
	3.2.1 Variabel Penelitian	31
	3.2.2 Definisi Operasional.....	31
	3.2.2.1 Variabel Dependen.....	31
	3.2.2.2 Variabel Independen	32
	3.3 Populasi dan Sampel Penelitian	34
	3.4 Teknik Pengumpulan Data.....	35
	3.5 Metode Analisis Data.....	36
	3.5.1 Analisis Statistik Deskriptif	36
	3.5.2 Uji <i>Outlier</i>	37
	3.5.3 Regresi Panel.....	37
	3.5.3.1 Pemilihan Model Terbaik.....	38
	3.5.3.1.1 Uji <i>Chow</i>	38
	3.5.3.1.2 Uji <i>Hausman</i>	38
	3.5.4 Uji Hipotesis	39
	3.5.4.1 Uji Signifikansi Simultan (Uji Statistik F).....	39
	3.5.4.2 Uji Signifikansi Parameter Individual (Uji Statistik t)	39
	3.5.4.3 <i>Goodness of fit model</i>	40
BAB IV	ANALISIS DAN PEMBAHASAN	41
	4.1 Statistik Deskriptif	41
	4.2 Hasil Uji <i>Outlier</i>	44
	4.3 Regresi Panel.....	44
	4.3.1 Pemilihan Model Terbaik.....	44
	4.3.1.1 Hasil Uji <i>Chow</i>	44
	4.3.1.2 Hasil Uji <i>Hausman</i>	45
	4.3.2 Hasil Uji F	46
	4.3.3 Hasil Uji t pada Variabel Dependen Volatilitas.....	46
	4.3.4 Hasil <i>Goodness of fit model</i>	53
BAB V	KESIMPULAN, KETERBATASAN, DAN REKOMENDASI	54
	5.1 Kesimpulan	54
	5.2 Keterbatasan.....	56
	5.2 Rekomendasi.....	56
	DAFTAR PUSTAKA	58
	BIOGRAFI MAHASISWA	64
	LAMPIRAN-LAMPIRAN	