

DAFTAR ISI

ABSTRAK	iv
PRAKATA	v
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Penelitian	1
1.2 Perumusan Masalah	6
1.3 Tujuan Penelitian	6
1.4 Manfaat Penelitian	7
1.5 Batasan Masalah	8
1.6 Sistematika Pembahasan.....	8
BAB II LANDASAN TEORI DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS	10
2.1 Teori Konseptual	10
2.1.1 Volatilitas Harga Saham	10
2.1.2 Kebijakan Dividen	13
2.1.3 <i>Leverage</i>	16
2.1.4 Volume Perdagangan.....	19
2.1.5 <i>Firm Size</i>	20
2.2 Penelitian Terdahulu	22
2.3 Kerangka Pemikiran	23
2.4 Model Penelitian.....	26
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	27
3.1 Objek dan Ruang Lingkup Penelitian	27
3.2 Metode Penelitian	27
3.3 Operasionalisasi Variabel Penelitian.....	28
3.3.1 Variabel Dependen	28
3.3.2 Variabel Independen	29
3.4 Teknik Penentuan Populasi dan Sampel	31
3.4.1 Populasi	31
3.4.2 Sampel	31
3.5 Metode Analisis Data.....	32
3.5.1 Analisis Statistika Deskriptif	32
3.5.2 Analisis Model Regresi Data Panel.....	32
3.5.3 Uji Asumsi Klasik.....	35
3.5.4 Uji Hipotesis	37
BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN	39
4.1 Deskripsi Data Penelitian.....	39
4.2 Analisis Statistika Deskriptif	40
4.3 Analisis Model Regresi Data Panel.....	42

4.3.1 Uji Chow (<i>Likelihood Ratio</i>).....	42
4.3.2 Uji Hausman	43
4.3.3 Uji <i>Lagrange Multiplier</i>	44
4.4 Uji Asumsi Klasik	45
4.4.1 Uji Normalitas	45
4.4.2 Uji Multikolinearitas	46
4.4.3 Uji Heteroskedastisitas	47
4.4.4 Uji Autokorelasi.....	48
4.5 Uji Hipotesis.....	49
4.5.1 Uji Simultan (Uji F).....	49
4.5.2 Uji Parsial (Uji <i>t</i>)	50
4.5.3 Uji Koefisien Determinasi <i>R – Squared (Adjusted R²)</i>	51
4.6 Analisis dan Rangkuman Penelitian.....	52
4.6.1 Pengaruh Kebijakan Dividen terhadap Volatilitas Harga Saham	53
4.6.2 Pengaruh <i>Leverage</i> terhadap Volatilitas Harga Saham	54
4.6.3 Pengaruh Volume Perdagangan terhadap Volatilitas Harga Saham	54
4.6.4 Pengaruh <i>Firm Size</i> terhadap Volatilitas Harga Saham.....	55
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	56
1.1 Kesimpulan.....	56
1.2 Saran.....	57
DAFTAR PUSTAKA.....	59
LAMPIRAN.....	63

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1 Volume Perdagangan (Total Per Tahun).....	2
Gambar 2 Kerangka Penelitian.....	26
Gambar 3 Uji Normalitas	46

DAFTAR TABEL

Tabel 1 Penelitian Terdahulu.....	22
Tabel 2 Operasional Tabel Penelitian Rentang Waktu Tahunan.....	30
Tabel 3 Kriteria Penulisan <i>Durbin - Watson</i> (DW).....	37
Tabel 4 Sampel Penelitian	39
Tabel 5 Perusahaan yang diteliti.....	40
Tabel 6 Analisa Statistika Deskriptif	40
Tabel 7 <i>Common Effect Model</i>	42
Tabel 8 Uji Chow	43
Tabel 9 Uji Hausman.....	43
Tabel 10 Uji Multikolinieritas	47
Tabel 11 Uji Heteroskedastisitas	47
Tabel 12 Uji Autokorelasi	48
Tabel 14 Uji Simultan (Uji F).....	50
Tabel 15 Uji Parsial (Uji <i>t</i>)	51
Tabel 16 Uji Koefisien Determinasi <i>R – Square (Adjusted R²)</i>	52

LAMPIRAN

Lampiran 1 Data Perhitungan	64
Lampiran 2 Uji Statistika Deskriptif.....	66
Lampiran 3 Uji Regresi <i>Common Effect Model</i>	66
Lampiran 4 Uji Chow	67
Lampiran 5 Uji Hausman	67
Lampiran 6 Uji Lagrange Multiplier.....	67
Lampiran 7 Uji Multikolinearitas	67
Lampiran 8 Uji Heteroskedastisitas	68
Lampiran 9 Uji Autokorelasi	68