

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN.....	ii
HALAMAN MOTO DAN PERSEMBAHAN.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	iv
KATA PENGANTAR	v
<i>ABSTRAC</i>	viii
ABSTRAK.....	ix
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GAMBAR.....	xv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xvi
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Permasalahan	6
1.3 Tujuan Penelitian	7
1.4 Manfaat Penelitian	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	
2.1 Landasan Teori	9
2.1.1 Saham.....	9
2.1.1.1 Jenis Saham	9
2.1.1.2 Nilai Saham	12

2.1.1.3 Volatilitas Harga Saham (Stock Price Voatility)	13
2.1.2 Efficiency Market Hyphotesis (EMH).....	16
2.1.3 Dividen.....	17
2.1.3.1 Jenis Dividen	18
2.1.3.2 Model Pembagian Dividen.....	19
2.1.3.3 Prosedur Pembagian Dividen.....	20
2.1.4 Kebijakan Dividen	20
2.1.4.1 Teori Kebijakan Dividen.....	21
2.1.4.2 Macam Kebijakan Dividen.....	27
2.1.4.3 Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Besar Kecilnya Rasio Pembayaran Dividen.....	29
2.1.4.4 Devidend Signaling Theory.....	35
2.1.5 Indikator Kebijakan Dividen.....	39
2.2 Penelitian Terdahulu.....	39
2.3 Hipotesis	41
2.3.1 Pengaruh <i>Devidend Yield</i> (DY) Terhadap Volatilitas Harga Saham.....	41
2.3.2 Pengaruh <i>Devidend Payout</i> (DP) Terhadap Volatilitas Harga Saham.....	43
2.3.3 Pengaruh <i>Earning Volatility</i> (EV) Terhadap Volatilitas Harga Saham.....	44
2.3.4 Pengaruh Ukuran Perusahaan (<i>Size</i>) Terhadap Volatilitas Harga Saham.....	44

2.3.5 Pengaruh Hutang (<i>Debt</i>) Terhadap	
Volatilitas Harga Saham	45
2.3.6 Pengaruh Pertumbuhan Perusahaan (<i>Growth</i>) Terhadap	
Volatilitas Harga Saham	45
2.4 Model Analisis	46
2.5 Kerangka Pemikiran	46
BAB III METODE PENELITIAN	
3.1 Pendekatan Penelitian	49
3.2 Identifikasi Variabel	49
3.3 Definisi Operasional	50
3.3.1 Variabel Dependen	50
3.3.2 Variabel Independen	50
3.3.3 Variabel Kontrol	52
3.4 Jenis dan Sumber Data	54
3.5 Prosedur Penentuan Sample	55
3.6 Prosedur Pengumpulan Data	55
3.7 Teknik Analisis	56
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	
4.1 Gambaran Umum Subjek dan Objek Penelitian	63
4.2 Deskripsi Hasil Penelitian	64
4.3 Analisis Model dan Pengujian Hipotesisi	65
4.3.1 Uji Asumsi Klasik	65
4.3.2 Analisis Model	70

4.3.3 Pengujian Hipotesis.....	72
4.3.3.1 Pengujian Hipotesis Secara Parsial (Uji t)	72
4.4 Pembahasan	
4.4.1 Pengaruh <i>Dividend Yield</i> Terhadap Volatilitas Harga Saham	73
4.4.2 Pengaruh <i>Dividend Payout</i> Terhadap Volatilitas Harga Saham	75
4.4.3 Pengaruh <i>Earning Volatility</i> Terhadap Volatilitas Harga Saham ..	77
4.4.4 Pengaruh <i>Size</i> Terhadap Volatilitas Harga Saham.....	77
4.4.5 Pengaruh <i>Debt</i> Terhadap Volatilitas Harga Saham	78
4.4.6 Pengaruh <i>Growth</i> Terhadap Volatilitas Harga Saham	80
BAB V SIMPULAN DAN SARAN	
5.1 Simpulan.....	81
5.2 Saran	82
DAFTAR PUSTAKA	
LAMPIRAN	

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu.....	40
Tabel 3.1 Pengambilan Keputusan Uji Durbin Watson.....	60
Tabel 4.1 Statistik Deskriptif.....	65
Tabel 4.2 Hasil Nilai <i>Tolerance</i> dan Nilai VIF Pengujian Multikolinearitas.....	68
Tabel 4.3 Hasil Pengujian Autokorelasi.....	69
Tabel 4.4 Hasil Analisis Regresi.....	70



DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran.....	48
Gambar 4.1 Pengujian Normalitas Data	67
Gambar 4.2 Scatterplot Uji Heteroskedastisitas	70



DAFTAR LAMPIRAN

1. LAMPIRAN NAMA PERUSAHAAN
2. LAMPIRAN DATA PERUSAHAAN
3. LAMPIRAN OUTPUT SPSS

