

DAFTAR ISI

JUDUL	i
PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
ABSTRACT	v
ABSTRAK	vi
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	vii
KATA PENGANTAR.....	viii
DAFTAR ISI.....	xi
DAFTAR TABEL	xiv
DAFTAR GAMBAR.....	xv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xvi
BAB I.....	1
PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	11
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian	14
1.3.1 Tujuan Penelitian	14
1.3.2 Kegunaan penelitian.....	14
1.4 Sistematika Penulisan	15
BAB II	17
TINJAUAN PUSTAKA	17
2.1 Landasan Teori	17
2.1.1 <i>Signalling Theory</i> (Teori Signal)	17
2.1.2 Efficiency Market Hypothesis (EMH).....	18
2.1.3 Tipe Investor	20
2.1.4 Pengertian Pasar Modal	23
2.1.5 Sejarah Pasar Modal di Indonesia.....	24

2.1.6	Saham.....	26
2.1.7	Jenis Risiko	29
2.1.8	Volatilitas Harga Saham	30
2.1.9	Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Volatilitas Harga Saham	32
2.2	Penelitian Terdahulu	36
2.2.1	Variabel <i>Firm Size</i> terhadap Volatilitas Harga Saham	36
2.2.2	Variabel <i>Leverage</i> (DER) terhadap Volatilitas Harga Saham	37
2.2.3	Variabel <i>Sales Growth</i> terhadap Volatilitas Harga Saham	38
2.2.4	Variabel <i>Trading Volume</i> terhadap Volatilitas Harga Saham.....	38
2.2.5	Variabel <i>Asset Growth</i> terhadap Volatilitas Harga Saham	39
2.3	Pengaruh Variabel Independen terhadap Variabel Dependen	42
2.3.1	Pengaruh <i>Firm Size</i> terhadap Volatilitas Harga Saham	42
2.3.2	Pengaruh <i>Leverage</i> (DER) terhadap Volatilitas Harga Saham	43
2.3.3	Pengaruh <i>Sales Growth</i> terhadap Volatilitas Harga Saham.....	45
2.3.4	Pengaruh <i>Trading Volume</i> terhadap Volatilitas Harga Saham	46
2.3.5	Pengaruh <i>Asset Growth</i> terhadap Volatilitas Harga Saham	47
2.4	Kerangka Pemikiran Teoritis	48
BAB III.....		50
METODE PENELITIAN.....		50
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional.....	50
3.1.1	Variabel Penelitian.....	50
3.1.2	Definisi Operasional	51
3.2	Populasi dan Sampel Penelitian.....	56
3.3	Jenis dan Sumber Data.....	59
3.4	Metode Pengumpulan Data.....	59
3.5	Metode Penelitian	59
3.5.1	Uji Asumsi Klasik.....	59
3.5.2	Analisis Regresi Berganda.....	65
3.5.3	Uji Hipotesis	66
BAB IV		70
ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN		70

4.1	Deskripsi Variabel Penelitian	70
4.2	Analisis Data.....	70
4.2.1	Statistik Deskriptif	70
4.2.2	Pengujian Asumsi Klasik.....	75
4.2.3	Analisis Regresi Linier Berganda	84
4.2.4	Pengujian Hipotesis	85
4.3	Interpretasi Hasil.....	89
4.3.1	Pengaruh <i>Firm Size</i> terhadap Volatilitas Harga Saham	90
4.3.2	Pengaruh <i>Leverage</i> terhadap Volatilitas Harga Saham.....	91
4.3.3	Pengaruh <i>Sales Growth</i> terhadap Volatilitas Harga Saham	92
4.3.4	Pengaruh <i>Trading Volume</i> terhadap Volatilitas Harga Saham	93
4.3.5	Pengaruh <i>Asset Growth</i> terhadap Volatilitas Harga Saham	94
BAB V	96
PENUTUP	96
5.1	Kesimpulan	96
5.2	Keterbatasan Penelitian.....	100
5.3	Saran	100
5.3.1	Bagi Perusahaan.....	100
5.3.2	Bagi Investor.....	101
5.3.3	Bagi Peneliti Selanjutnya.....	102
DAFTAR PUSTAKA	104
LAMPIRAN	109