

DAFTAR ISI

Halaman judul	i
Persetujuan Skripsi	ii
Pengesahan Kelulusan Ujian	iii
Pernyataan Orisinalitas Skripsi	iv
Motto dan Persembahan	v
Abstrak	vi
<i>Abstract</i>	vii
Kata Pengantar	viii
Daftar Tabel	xiv
Daftar Gambar	xv
Daftar Lampiran	xvi
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar belakang.....	1
1.2 Perumusan Masalah	11
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian	13
1.4 Sistematika Penulisan	15
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	
2.1 Definisi Konsep	17
2.1.1 Volatilitas Harga Saham	17
2.1.2 ROE	17
2.1.3 <i>Sales Growth</i>	19
2.1.4 <i>Dividend Yield</i>	20
2.1.5 <i>Firm Size</i>	21
2.1.6 <i>Book to Market</i>	21
2.1.7 Momentum	23

2.1.8 Teory Fama and French	26
2.2 Pengaruh Variabel Independen terhadap Variabel Dependen	27
2.2.1 Pengaruh ROE terhadap Volatilitas Harga Saham	27
2.2.2 Pengaruh <i>Sales Growth</i> terhadap Volatilitas Harga Saham ...	28
2.2.3 Pengaruh <i>Dividend Yield</i> terhadap Volatilitas Harga Saham	29
2.2.4 Pengaruh <i>Firm Size</i> terhadap Volatilitas Harga Saham	30
2.2.5 Pengaruh <i>Book to Market</i> terhadap Volatilitas Harga Saham	31
2.2.6 Pengaruh Momentum terhadap Volatilitas Harga Saham	31
2.3 Penelitian Terdahulu	31
2.4 Kerangka Pemikiran Teoritis	38
2.5 Perumusan Hipotesis	39

BAB III METODE PENELITIAN

3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel	39
3.1.1 Volatilitas Harga Saham	39
3.1.2 ROE	41
3.1.3 <i>Sales Gwoth</i>	42
3.1.4 <i>Dividend Yield</i>	42
3.1.5 <i>Firm Size</i>	43
3.1.6 <i>Book to Market</i>	43
3.1.7 Momentum	43
3.2 Populasi dan Sampel	45
3.3 Jenis dan Sumber data	46
3.4 Metode Pengumpulan Data	46
3.5 Metode Analisis Data	47
3.5.1 Uji Asumsi Klasik	48

3.5.1.1 Uji Normalitas	49
3.5.1.2 Uji Multikolinearitas	51
3.5.1.3 Uji Heteroskedastisitas	53
3.5.1.4 Uji Autokorelasi	54
3.5.2 Analisis Regresi Linear Berganda	55
3.5.3 Uji Hipotesis	56
3.5.3.1 Koefisien Determinasi (R^2)	56
3.5.3.2 Uji F Statistik	57
3.5.3.3 Uji t Statistik	59

BAB IV ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN

4.1 Deskripsi Obyek Penelitian	63
4.2 Statistika Deskriptif	64
4.3 Hasil Analisis Data	65
4.3.1 Hasil Asumsi Klasik	65
4.3.1.1 Hasil Uji Normalitas	66
4.3.1.2 Hasil Uji Multikolineritas	69
4.3.1.3 Hasil Uji Autokorelasi	70
4.3.1.4 Hasil Uji Heteroskedastisitas	71
4.3.2 Persamaan Regresi Linear Berganda	73
4.3.3 Uji Hipotesis	74
4.3.3.1 Uji F Statistik	74

4.3.3.2 Uji t Statistik	75
4.3.4 Uji Koefisien Determinasi	78
4.4 Pembahasan	79
BAB V PENUTUP	
5.1 Kesimpulan	80
5.2 Keterbatasan Penelitian	82
5.3 Saran	83
DAFTAR PUSTAKA	85
LAMPIRAN-LAMPIRAN	88