

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN KELULUSAN .....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN.....	v
ABSTRACT .....	vi
ABSTRAK .....	vii
KATA PENGANTAR.....	viii
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GAMBAR .....	xv
DAFTAR LAMPIRAN .....	xvi
BAB I PENDAHULUAN .....	1
1.1 Latar Belakang Masalah .....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	11
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian.....	11
1.3.1 Tujuan Penelitian.....	12
1.3.2 Kegunaan Penelitian .....	12
1.4 Sistematika Penulisan .....	13
BAB II TINJAUAN PUSTAKA .....	15
2.1 Landasan Teori.....	15
2.1.1 Pengertian Pasar Modal .....	15

2.1.2 Saham .....	17
2.1.3 Indeks Harga Saham.....	18
2.1.4 Volatilitas Harga Saham .....	22
2.2 Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Volatilitas Harga Saham .....	25
2.2.1 Volume perdagangan.....	25
2.2.2 Inflasi .....	27
2.2.3 Nilai Tukar .....	27
2.2.4 Tingkat Suku Bunga.....	29
2.3 Penelitian Terdahulu.....	31
2.4 Kerangka Pemikiran Teoritis dan Perumusan Hipotesis .....	35
2.4.1 Pengaruh volume perdagangan terhadap volatilitas harga saham .....	36
2.4.2 Pengaruh inflasi terhadap volatilitas harga saham .....	37
2.4.3 Pengaruh nilai tukar terhadap volatilitas harga saham .....	37
2.4.4 Pengaruh suku bunga terhadap volatilitas harga saham .....	39
2.5 Hipotesis .....	40
<b>BAB III METODE PENELITIAN .....</b>	<b>42</b>
3.1 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional.....	42
3.1.1 Variabel Penelitian .....	42
3.1.2 Definisi Operasional.....	42
3.1.2.1 Variabel Dependen .....	42
3.1.2.2 Variabel Independen .....	43
3.2 Populasi dan Sampel Penelitian .....	45

3.3 Jenis dan Sumber Data.....	47
3.4 Metode Pengumpulan Data.....	48
3.5 Metode Analisis.....	48
3.5.1 Statistik Deskriptif.....	48
3.5.2 Analisis Regresi Berganda.....	51
3.5.3 Uji Asumsi Klasik .....	50
3.5.3.1 Normalitas .....	50
3.5.3.2 Multikolinearitas.....	51
3.5.3.3 Heterokedastisitas .....	52
3.5.3.4 Autokorelasi .....	52
3.5.4 Pengujian Hipotesis.....	53
3.5.4.1 Uji F Statistik.....	53
3.5.4.2 Koefisien Determinan ( $R^2$ ).....	54
3.5.4.3 Uji T Statistik .....	55
<b>BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN .....</b>	<b>57</b>
4.1 Gambaran Umum Objek Penelitian.....	57
4.2 Statistik Deskriptif.....	58
4.3 Hasil Uji Asumsi Klasik .....	59
4.3.1 Uji Normalitas .....	60
4.3.2 Uji Multikolinearitas.....	62
4.3.3 Uji Heterokedastisitas.....	63
4.3.4 Uji Autokorelasi .....	65
4.4 Analisis Regresi dan Hasil Pengujian Hipotesis .....	66

4.4.1 Analisis Regresi.....	66
4.4.2 Hasil Pengujian Hipotesis secara Simultan (Uji F).....	68
4.4.3 Pengujian Determinan ( $R^2$ ).....	69
4.4.4 Hasil Pengujian Hipotesis secara Parsial (Uji T).....	69
4.5 Pembahasan.....	72
BAB V PENUTUP.....	75
5.1 Simpulan .....	75
5.2 Keterbatasan.....	77
5.3 Saran .....	77
DAFTAR PUSTAKA .....	79
LAMPIRAN .....	82