

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL .....	ii
HALAMAN PERNYATAAN .....	iii
LEMBAR PENGESAHAN .....	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN .....	v
HALAMAN MOTTO.....	vi
KATA PENGANTAR .....	vii
ABSTRAKSI .....	ix
DAFTAR ISI .....	x
DAFTAR TABEL .....	xii
DAFTAR GAMBAR .....	xiii
DAFTAR LAMPIRAN .....	xiv
BAB I PENDAHULUAN .....	1
A. Latar Belakang Masalah .....	1
B. Rumusan Masalah.....	12
C. Tujuan Penelitian .....	13
D. Manfaat Penelitian .....	14
BAB II TINJAUAN PUSTAKA .....	16
A. Landasan Teori.....	16
1. Teori Efficiency Market Hypothesis .....	15
2. Signaling Theory.....	18
3. Pasar Modal .....	20
4. Saham.....	24
5. Harga Saham.....	26
6. Indeks Harga Saham .....	28
7. Volatilitas Harga Saham .....	31
8. Kebijakan Dividen .....	38
9. <i>Dividend Payout Ratio</i> .....	41
10. <i>Leverage</i> .....	44
11. <i>Firm Size</i> .....	48

12. Volume Perdagangan .....	50
13. <i>Earning Volatility</i> .....	52
14. Inflasi .....	53
B. Penelitian Terdahulu .....	57
C. Pola Hubungan Antar Variabel .....	61
D. Kerangka Konseptual .....	66
E. Hipotesis Penelitian .....	67
BAB III METODE PENELITIAN .....	68
A. Rancangan Penelitian .....	68
B. Objek dan Waktu Penelitian .....	68
C. Populasi.....	69
D. Sampel dan Teknik Pengambilan Sampel.....	69
E. Jenis Data dan Sumber Pengambilan Data .....	70
F. Teknik Pengumpulan Data.....	70
G. Klasifikasi Variabel Penelitian .....	71
H. Definisi Operasional Variabel.....	72
I. Metode Analisis Data.....	75
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	80
A. Hasil Penelitian .....	81
B. Pembahasan.....	96
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN .....	101
A. Kesimpulan .....	101
B. Saran .....	102
DAFTAR PUSTAKA .....	103
LAMPIRAN .....	107