

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN PEMBIMBING	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
HALAMAN MOTTO DAN PERSEMBAHAN	iv
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI.....	v
HALAMAN ABSTRAKSI.....	vi
KATA PENGANTAR.....	vii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR.....	xiii

BAB I. PENDAHULUAN

A. Latar Belakang	1
B. Rumusan Masalah	6
C. Hipotesis.....	6
D. Tujuan Penelitian	6
E. Manfaat Penelitian	7
F. Metode Penelitian	7
1. Jenis Penelitian.....	7
2. Populasi dan Sampel	8
3. Jenis Data Penelitian dan Pengumpulan Data.....	8

4. Teknik Analisis Data.....	9
a. Uji Asumsi Klasik	9
b. Uji Hipotesis	9
G. Sistematika Penulisan	9

BAB II. LANDASAN TEORI

A. Pasar Modal	11
B. Saham.....	12
C. Harga Saham	13
D. Teori Pesinyalan (<i>Signaling Theory</i>)	13
E. Teori Efisiensi Pasar	15
F. Volume Perdagangan Saham	18
G. Laba Bersih	19
H. Faktor Ekonomi Makro	21

BAB III. METODOLOGI PENELITIAN

A. Jenis Penelitian	30
B. Populasi dan Sampel	30
C. Variabel Penelitian	31
D. Model Penelitian	32
E. Jenis Data dan Sumber Data Penelitian.....	33
F. Teknik Pengumpulan Data	33
G. Teknik Analisa Data	34
1. Uji Asumsi Klasik.....	35
a. Uji Normalitas.....	35

b. Uji Multikolinearitas	35
c. Uji Heteroskedastisitas	36
d. Uji Autokorelasi	37
2. Uji Hipotesis	38

BAB IV. ANALISIS DAN PEMBAHASAN

A. Populasi dan Sampel	40
B. Statistik Deskriptif.....	41
C. Uji Asumsi Klasik	42
D. Pengujian Hipotesis.....	47
E. Pembahasan Hasil	51

BAB V. SIMPULAN DAN SARAN

A. Simpulan	58
B. Keterbatasan Penelitian	59
C. Saran	59

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

DAFTAR TABEL

Tabel 3.1 Kriteria Sampel	31
Tabel 4.1 Nama – nama Perusahaan Sampel	40
Tabel 4.2 Statistik Deskriptif	41
Tabel 4.3 Hasil Uji Kolmogorov-Smirnov I	43
Tabel 4.4 Hasil Uji Kolmogorov-Smirnov II.....	44
Tabel 4.5 Hasil Uji Multikolinearitas	45
Tabel 4.6 Hasil Uji Autokorelasi	47
Tabel 4.7 Hasil Analisis Regresi Berganda dan Uji Parsial (T).....	48
Tabel 4.8 Hasil Uji Koefisien Determinasi	51

DAFTAR GAMBAR

Gambar 3.1 Model Penelitian I	33
Gambar 4.1 Hasil Uji Heteroskedastisitas	46