

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI	ii
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	iii
ABSTRAK.....	iv
ABSTRACT.....	v
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR.....	x
DAFTAR LAMPIRAN	xi
 BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Penelitian.....	1
B. Rumusan Masalah Penelitian.....	12
C. Tujuan dan Kontribusi Penelitian	12
1. Tujuan Penelitian.....	12
2. Kontribusi Penelitian	13
 BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS.....	14
A. Kajian Pustaka	14
1. Teori Sinyal (<i>Signaling Theory</i>).....	14
2. Volatilitas Harga Saham (<i>Stock Price Volatility</i>).....	15
3. Dividen.....	22
4. <i>Asset Growth</i>	29
5. Penelitian Terdahulu	30
B. Kerangka Pemikiran.....	37
C. Pengembangan Hipotesis.....	38
 BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....	42
A. Waktu dan Tempat Penelitian.....	42
B. Desain Penelitian.....	42
C. Definisi dan Operasional Variabel Penelitian.....	42
1. Definisi Variabel Penelitian	42
2. Operasionalisasi Variabel Penelitian	44
D. Populasi dan Sampel Penelitian.....	45
1. Populasi Penelitian	45
2. Sampel Penelitian	45
E. Teknik Pengumpulan Data	47
F. Metode Analisis Data	47
1. Analisis Deskriptif.....	48
2. Uji Stasioneritas Data	48

3.	Pemilihan Model GARCH	49
4.	Uji Asumsi Klasik	52
5.	Uji Hipotesa Model GARCH	54
BAB IV PEMBAHASAN		57
A.	Gambaran Umum Objek Penelitian	57
B.	Hasil Uji Statistik Deskriptif	61
C.	Hasil Uji Stasioneritas Data.....	63
D.	Hasil Pemilihan Model GARCH.....	67
E.	Hasil Uji Asumsi Klasik.....	69
1.	Hasil Uji Normalitas	70
2.	Hasil Uji Heteroskedastisitas	70
3.	Hasil Uji Multikolinearitas.....	71
F.	Hasil Uji Hipotesa Model GARCH (1,2)	72
1.	Hasil Uji Koefisien Determinasi (R^2)	72
2.	Hasil Uji F-Statistik.....	72
3.	Hasil Uji t-Statistik	73
G.	Pembahasan Hasil Penelitian	76
BAB V SIMPULAN DAN SARAN		80
A.	Simpulan.....	80
B.	Saran.....	80
DAFTAR PUSTAKA		82
LAMPIRAN		90

UNIVERSITAS MERCU BUANA
MERCU BUANA