

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL</b> .....	<b>ii</b>
<b>PERNYATAAN</b> .....	<b>iii</b>
<b>HALAMAN PERSETUJUAN</b> .....	<b>iv</b>
<b>HALAMAN PENGESAHAN</b> .....	<b>v</b>
<b>DAFTAR RIWAYAT HIDUP</b> .....	<b>vi</b>
<b>MOTO</b> .....	<b>vii</b>
<b>HALAMAN PERSEMBAHAN</b> .....	<b>viii</b>
<b>KATA PENGANTAR</b> .....	<b>ix</b>
<b>ABSTRAK</b> .....	<b>xi</b>
<b>ABSTRACT</b> .....	<b>xii</b>
<b>DAFTAR ISI</b> .....	<b>xiii</b>
<b>DAFTAR TABLE</b> .....	<b>xiv</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN</b> .....	<b>xv</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN</b>	
1.1. Latar Belakang .....	1
1.2. Perumusan Masalah .....	5
1.3. Tujuan Penelitian .....	5
1.4. Manfaat Penelitian .....	6
1.5. Sistematika Penulisan .....	6
<b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA</b>	
2.1 Landas Teori Sinyal ( <i>Signaling</i> ).....	8
2.1.1 Harga Saham .....	8
2.1.1.1 Pengertian Saham.....	8
2.1.1.2 Jenis Saham.....	9
2.1.1.3 Pengertian Harga Saham.....	10
2.1.1.4 Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Harga Saham. ....	11
2.1.2 Reaksi pasar.....	11
2.1.3 Abnormal Return.....	12
2.1.4 Volume Perdagangan Saham.....	13
2.1.5 Inflasi.....	<b>13</b>

2.2 Penelitian Terdahulu.....	14
2.3 Kerangka Konseptual. ....	17
2.4 Hipotesis Penelitian.....	18

**BAB III METODE PENELITIAN**

3.1 Jenis Penelitian dan Sumber Data. ....	21
3.2 Metode Pengumpulan Data. ....	21
3.3 Populasi dan Sampel. ....	22
3.3.1 Populasi.....	22
3.3.2 Sampel.....	22
3.4 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional. ....	23
3.5 Metode Analisis Data. ....	25
3.5.1 Analisis Statistik Deskriptif.....	26
3.5.2 Uji Asumsi klasik.....	26
3.5.2.1 Uji Normalitas Data.....	26
3.5.2.2 Uji Heteroskedastisitas.....	26
3.5.2.3 Uji Multikolonieritas.....	27
3.5.2.4 Uji Autokorelasi.....	27
3.5.3 Analisis Regresi Linier Berganda.....	28
3.5.4 Koefisien Determinasi (R <sup>2</sup> ).....	29
3.5.5 Uji F (Uji Signifikansi Simultan).....	29
3.5.6 Uji Statistik t.....	30

**BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN**

4.1 Deskripsi dan Objek Penelitian.....	31
4.1.1 Data dan Sampel. ....	31
4.2 Hasil dan Deskriptif. ....	32
4.2.1 Statistik Deskriptif.....	32
4.2.2 Uji Asumsi klasik.....	34
4.2.2.1 Uji Normalias.....	34
4.2.2.2 Uji Multikolinieias.....	35
4.2.2.3 Uji Autokorelasi.....	36
4.2.2.4 Uji Heteroskedatisitas.....	37

4.2.2.5 Model Regresi Linear Berganda .....	39
4.3 Hasil Pengujian Hipotesis .....	40
4.3.1 Uji Koefisien Determinasi ( $R^2$ ).....	40
4.3.2 Uji F. ....	41
4.3.3 Uji T.....	41
4.4 Pembahasan Hasil Penelitian. ....	43
4.4.1 Pengaruh Abnormal Return Terhadap Harga Saham. ....	43
4.4.2 Pengaruh Volume Perdagangan Terhadap Harga Saham.....	43
4.4.3 Pengaruh Inflasi Terhadap Harga Saham. ....	44
<b>BAB V PENUTUP</b>	
5.1 Kesimpulan. ....	46
5.2 Saran. ....	46

**DAFTAR PUSTAKA**

**LAMPIRAN**

## DAFTAR TABEL

<b>TABEL</b>	<b>HALAMAN</b>
Tabel 1.1 pergerakan harga saham.....	2
Tabel 2.1 Penelitian terdahulu .....	16
Tabel 3.1 kriteria uji autokorelasi .....	32
Table 4.1 kriteria sampel.....	35
Table 4.2 hasil analisis data .....	36
Tabel 4.3 Hasil Uji Normalitas .....	38
Tabel 4.4 Hasil Uji Multikolinieritas .....	40
Tabel 4.5 Hasil Uji Autokorelasi .....	41
Tabel 4.6 Hasil Uji Autokorelasi .....	41
Tabel 4.7 Hasil Uji Heteroskedastisitas .....	43
Tabel 4.8 Hasil Regresi Linier Berganda.....	44
Tabel 4.9 Hasil Uji Koefisien Determinasi ( $R^2$ ).....	45
Tabel 4.10 Hasil Uji Statistik F.....	46
Tabel 4.11 Hasil Uji Statistik t.....	47