

DAFTAR ISI

ABSTRAK	i
ABSTRACT	ii
KATA PENGANTAR.....	iii
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL	viii
DAFTAR GAMBAR.....	ix
DAFTAR GRAFIK	x
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Identifikasi Masalah	7
1.3 Rumusan Masalah	8
1.4 Batasan Masalah.....	8
1.5 Tujuan Penelitian.....	8
1.6 Manfaat Penelitian.....	9
BAB II KAJIAN PUSTAKA	10
2.1 Kerangka Teoritis	10
2.1.1 Harga Saham	10
2.1.1.1 Abnormal Return	15
2.1.1.2 Volume perdagangan saham.....	17
2.1.1.3 Pengumuman Dividen (Dividend Announcement).....	19
2.1.1.3.1 Dividen.....	19
2.1.1.4 Studi Peristiwa (Event Study).....	25
2.2 Penelitian Yang Relevan	25
2.3 Kerangka Berfikir	31
2.4 Hipotesis Penelitian	32
BAB III METODE PENELITIAN	34
3.1 Lokasi dan Waktu Penelitian.....	34
3.2 Populasi Dan Sampel.....	34
3.3 Variabel Penelitian Operasional	36
3.3.1 Harga Saham.....	36

3.3.2 Variabel Volume perdagangan saham	39
3.4 Teknik Pengumpulan Data Penelitian	40
3.5 Teknik Analisis Data	41
3.5.1 Menentukan Periode Pengamatan.....	41
3.5.2 Uji Asumsi Klasik.....	42
3.5.2.1 Uji normalitas	42
3.5.3 Uji Hipotesis	44
BAB VI HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	45
4.1 Deskripsi Data Penelitian	45
4.1.1 Gambaran Objek Penelitian	45
4.1.2 Data Perusahaan.....	46
4.2 Hasil Penelitian.....	58
4.2.1 Analisis Statistik Deskriptif.....	59
4.2.2 Uji Asumsi Klasik.....	61
4.2.3 Uji Homogenitas	62
4.2.4 Analisis Statistik	63
4.3 Pembahasan Hasil Penelitian.....	66
4.3.1 Pengaruh pengumuman dividen terhadap volume perdagangan saham	66
4.3.2 Pengaruh pengumuman dividen terhadap harga saham.....	69
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	78
5.1 Kesimpulan.....	78
5.2 Saran	79
DAFTAR PUSTAKA	80
LAMPIRAN.....	80