

DAFTAR ISI

KATA PENGANTAR.....	ii
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
INTISARI.....	xiv
ABSTRACT.....	xv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Pertanyaan Penelitian	3
1.3. Tujuan Penelitian	4
1.4. Manfaat penelitian	5
1.5. Batasan dan Ruang Lingkup Penelitian.....	5
BAB II LANDASAN TEORI	7
2.1 Kajian Teori	7
2.1.1 <i>Assymetric auto rejection</i>	7
2.1.2 Volatilitas Harga Saham.....	8
2.1.3 Volume Perdagangan Saham.....	9

2.1.4 Total Aset	10
2.1.5 ROA	11
2.1.6 Indeks LQ45	12
2.1.7 Indeks PEFINDO 25	12
2.2 Penelitian Terdahulu	13
2.3 Pengembangan Hipotesis	20
2.3.1 Hipotesis: Pengaruh <i>Asymmetric Auto rejection</i> terhadap Volatilitas Saham.....	20
2.3.2 Hipotesis: Pengaruh <i>Asymmetric Auto rejection</i> terhadap Volume Perdagangan Saham.....	21
BAB III METODE PENELITIAN.....	23
3.1 Desain Penelitian	23
3.2 Pengukuran dan Operasionalisasi.....	25
3.2.1 Variabel Independen	25
3.2.2 Variabel Dependen	26
3.2.3 Variabel Kontrol.....	28
3.3 Desain Pengambilan Sampel	29
3.3.1 Metode Pengambilan Sampel	29
3.3.2 Populasi.....	30
3.3.3 Unit Sampel	30

3.3.4 Ukuran Sampel	35
3.4 Metode Pengumpulan Data	36
3.5 Metode Analisis Data	36
3.5.1 Metode Pengolahan Data	36
3.5.2 Analisis Statistif Deskriptif.....	36
3.5.3 Uji Beda Non-Parametrik	37
1.5.4 Model Regresi Data Panel.....	37
3.5.5 Pemilihan Estimasi Model Regresi Data Panel	39
3.5.6 Uji Asumsi Klasik.....	40
3.5.7 Interpretasi Hasil Regresi.....	42
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	45
4.1. Deskripsi Data	45
4.2. Analisis Statistif Deskriptif	46
4.3. Uji Hipotesis.....	50
4.3.1 Uji Beda Non Parametrik.....	50
4.3.2. Pemilihan Model Estimasi Terbaik.....	55
4.4. Uji Asumsi Klasik	58
4.4.1 Uji Multikolinearitas.....	58
4.4.2 Uji Heterokedasitas.....	58
4.5. Pengujian Statistik.....	59

4.5.1. Interpretasi Hasil Regresi.....	59
4.5.2. Koefisien Determinasi	62
4.5.3 Pengujian Signifikansi Model.....	63
4.5.4 Pengujian Signifikansi Parsial	66
4.6. Diskusi dan Pembahasan	69
4.6.1 Volatilitas Historis <i>Return</i> Saham.....	69
4.6.2 Trading Volume Activity.....	72
BAB V SIMPULAN	75
5.1 Simpulan.....	75
5.2 Implikasi.....	76
5.3 Saran.....	77
5.4 Keterbatasan	78