

ABSTRAK

Volatilitas harga saham merupakan pergerakan naik atau turunnya perusahaan. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh kebijakan dividen, laba bersih dan ukuran perusahaan terhadap volatilitas harga saham. Jenis penelitian dalam penelitian ini adalah penelitian kuantitatif dengan metode pengumpulan data menggunakan metode dokumenter. Lokasi dari penelitian ini adalah PT. Unilever Indonesia Tbk periode 2009-2018.

Penelitian ini menggunakan metode analisis statistik deskriptif, regresi linear berganda dan uji asumsi klasik. Dari hasil analisis data diketahui bahwa hasil uji secara parsial (uji t) dan hasil uji secara simultan (uji F), menunjukkan bahwa variabel kebijakan dividen, laba bersih dan ukuran perusahaan tidak berpengaruh secara signifikan terhadap volatilitas harga saham.

Kata Kunci : volatilitas, kebijakan dividen, laba bersih, ukuran perusahaan

ABSTRACT

Stock price volatility is the movement of the rise or fall of the company. This study discusses dividend policy, net income and company size on stock price volatility. The type of research in this study is quantitative research using data collection methods using documentary methods. The location of this research is PT. Unilever Indonesia Tbk period 2009-2018.

*This study uses descriptive statistical analysis methods, multiple linear regression and classic assumption tests. From the results of data analysis it is known that the results of the partial test (*t* test) and the results of the simultaneous test (*F* test), indicate that the policy variables are dividend, net income and size the company has no significant effect on stock price volatility.*

Keywords: volatility, dividend, net profit, firm size