

## DAFTAR ISI

LEMBAR JUDUL.....	i
SURAT PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI.....	ii
SURAT KETERANGAN PENGGANTI LEMBAR PENGESAHAN DAN PERSETUJUAN KARYA TULIS AKHIR .....	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR GAMBAR .....	ix
DAFTAR LAMPIRAN .....	x
INTISARI.....	xi
<i>ABSTRACT</i> .....	xii
BAB I PENDAHULUAN .....	1
1.1    Latar Belakang .....	1
1.2    Rumusan Masalah .....	4
1.3    Pertanyaan Penelitian .....	5
1.4    Tujuan Penelitian .....	5
1.5    Manfaat Penelitian .....	6
1.6    Sistematika Penulisan.....	7
BAB II LANDASAN TEORI .....	8
2.1    Landasan Teori.....	8
2.1.1    Price Earning Ratio (PER) dalam Penilaian Saham.....	8
2.1.2    Value Stock dan Growth Stock .....	10
2.1.3    Size Effect.....	12
2.2    Kajian Penelitian Terdahulu.....	13
2.3    Perumusan Hipotesis.....	14
2.4    Model Penelitian .....	14
BAB III METODA PENELITIAN .....	15
3.1    Desain dan Ruang Lingkup Penelitian.....	15
3.2    Data dan Sampel .....	16
3.2.1    Sampel Penelitian.....	16
3.2.2    Data Penelitian .....	16
3.2.3    Teknik Pengambilan Sampel.....	17

3.3	Definisi Operasional dan Pengukuran Variabel.....	18
3.3.1	Pembentukan Portofolio <i>Value Stock</i> dan <i>Growth Stock</i> .....	18
3.3.1.1	Value Stock.....	18
3.3.1.2	Growth Stock .....	19
3.3.2	Ukuran Perusahaan.....	19
3.3.3	Pengukuran Kinerja Perusahaan .....	20
3.4	Pengujian Hipotesis.....	20
3.5	Metode Analisis Data.....	22
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN .....		24
4.1	Deskripsi Data.....	24
4.1.1	Kategorisasi <i>Small Cap</i> dan <i>Big Cap</i> .....	24
4.1.2	PER <i>Value Stock</i> dan <i>Growth Stock</i> Kategori <i>Small Cap</i> .....	25
4.1.3	PER <i>Value Stock</i> dan <i>Growth Stock</i> Kategori <i>Big Cap</i> .....	26
4.1.4	Kinerja <i>Value Stock</i> dan <i>Growth Stock</i> Kategori <i>Small Cap</i> .....	28
4.1.5	Kinerja <i>Value Stock</i> dan <i>Growth Stock</i> Kategori <i>Big Cap</i> .....	29
4.2	Analisis Data .....	31
4.2.1	Kinerja <i>Value Stock</i> dan <i>Growth Stock</i> Kategori <i>Small Cap</i> .....	31
4.2.2	Kinerja <i>Value Stock</i> dan <i>Growth Stock</i> Kinerja <i>Big Cap</i> .....	32
4.2.3	Kinerja ( <i>Value Premium</i> ) Kategori <i>Small Cap</i> dan <i>Big Cap</i> .....	33
4.3	Pengujian Hipotesis.....	34
4.3.1	Uji Normalitas.....	34
4.3.2	Uji Komparatif .....	35
4.3.2.1	Value Stock dan Growth Stock Kategori Small Cap .....	35
4.3.2.2	Value Stock dan Growth Stock Kategori Big Cap.....	36
4.3.2.3	Value Premium Kategori Small Cap dan Big Cap.....	37
4.4	Pembahasan.....	38
BAB V SIMPULAN .....		41
5.1	Simpulan .....	41
5.2	Implikasi.....	41
5.3	Keterbatasan.....	42
5.4	Saran.....	42
DAFTAR PUSTAKA .....		43
LAMPIRAN.....		44