UNIVERSITAS
GADJAH MADA
PENGARUH PRICE PER EARNINGS RATIO EFFECT DAN SIZE EFFECT TERHADAP WINNER-LOSER EFFECT: PENGUJIAN PADA SAHAM-SAHAM DALAM JAKARTA ISLAMIC INDEX (JII)
AZELLIA ALMA SHAFIRA, Agus Setiawan, Dr., M.Soc.Sc.,
Universitas Gadjah Mada, 2020 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL……i

HALAMAN PENGESAHAN…….....ii

HALAMAN PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI……...…iii

KATA PENGANTAR……....iv

DAFTAR ISI vii

DAFTAR TABEL ix

DAFTAR LAMPIRAN X

INTISARI……...xi

ABSTRACT…….....……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 5
1.6. Sistematika Penulisan 6

BAB II LANDASAN TEORI.....8

2.1. Keuangan Keperilakuan.....8
2.2. *Efficient Market Hypothesis* (EMH) 9
2.3. Anomali Pasar.....11
2.3.1. *Market Overreaction*.....12
2.3.2. *Size Effect*.....14
2.3.3. *P/E Effect* 15
2.4. Jakarta Islamic Index (JII) 16
2.5. Penelitian Terdahulu 17

UNIVERSITAS
GADJAH MADA
**PENGARUH PRICE PER EARNINGS RATIO EFFECT DAN SIZE EFFECT TERHADAP WINNER-LOSER EFFECT: PENGUJIAN
PADA SAHAM-SAHAM DALAM JAKARTA ISLAMIC INDEX (JII)**
AZELLIA ALMA SHAFIRA, Agus Setiawan, Dr., M.Soc.Sc.,
Universitas Gadjah Mada, 2020 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

2.6. Hipotesis Penelitian 19

BAB III METODE PENELITIAN 22

3.1. Desain Sampel 22
3.2 Metode Pengumpulan Data.....23
3.3 Definisi Operasional 25
3.4. Pengujian Hipotesis Pertama 26
3.5. Pengujian Hipotesis Kedua.....29
3.6. Pengujian Hipotesis Ketiga.....30

BAB IV ANALISIS HASIL PENELITIAN.....32

4.1 Statistik Deskriptif.....32
4.2 Uji Normalitas 37
4.3 Pengujian Hipotesis 41
4.3.1 Hasil Pengujian Hipotesis Pertama.....41
4.3.2 Hasil Pengujian Hipotesis Kedua 45
4.3.3 Hasil Pengujian Hipotesis Ketiga 52
4.4 Pembahasan 59
4.4.1 Pembahasan Hipotesis Pertama 59
4.4.2 Pembahasan Hipotesis Kedua.....60
4.4.3 Pembahasan Hipotesis Ketiga.....61

BAB V PENUTUP 63

5.1 Simpulan.....63
5.2 Keterbatasan Penelitian.....64
5.3 Saran 65

DAFTAR PUSTAKA.....66