

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
PERSETUJUAN PEMBIMBING SKRIPSI	ii
PENGESAHAN MUNAQOSAH	iii
PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI	iv
ABSTRAK	v
MOTTO	vi
PERSEMBAHAN	vii
PEDOMAN TRANSLITERASI ARAB-LATIN	viii
KATA PENGANTAR	ix
DAFTAR ISI	x
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Rumusan Masalah	10
C. Tujuan Penelitian	11
D. Manfaat Penelitian	11
E. Sistematika Penulisan.....	12
BAB II LANDASAN TEORI	14
A. Deskripsi Teori	14
1. <i>Signalling Theory</i>	14
2. <i>Window Dressing</i>	18
3. <i>Ramadhan Effect</i>	22
4. <i>Firm Size</i>	27
5. Volatilitas Harga Saham	29
6. Pasar Modal	31
7. Saham Syariah dan <i>Jakarta Islamic Index</i>	36
B. Penelitian Terdahulu	38
C. Kerangka Berpikir.....	41
D. Hipotesis Penelitian	43
BAB III METODE PENELITIAN	45
A. Jenis dan Pendekatan Penelitian	45
B. <i>Setting</i> Penelitian	46
C. Populasi dan Sampel.....	46
D. Desain dan Definisi Operasional Variabel Penelitian	49
E. Teknik Pengumpulan Data	51
F. Teknik Analisis Data	52

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	58
A. Hasil Penelitian.....	58
1. Gambaran Umum Objek Penelitian	58
2. Deskripsi Data Penelitian	63
B. Pengujian Data.....	75
1. Uji Statistik Deskriptif.....	75
2. Uji Normalitas	75
3. Uji Multikolinearitas	78
4. Uji Heteroskedastisitas	78
5. Uji Autokorelasi	79
C. Analisis Data.....	80
1. Uji Regresi Linear Berganda	80
2. Uji T (Parsial).....	81
3. Uji F (Stimulan)	83
4. Uji Koefisien Determinasi (R^2).....	84
D. Pembahasan	85
1. Pengaruh <i>window dressing</i> terhadap volatilitas harga saham	85
2. Pengaruh <i>ramadhan effect</i> terhadap volatilitas harga saham	87
3. Pengaruh <i>firm size</i> terhadap volatilitas harga saham.....	88
4. Pengaruh <i>window dressing, ramadhan effect, dan firm size</i> terhadap volatilitas harga saham	90
BAB V PENUTUP.....	92
A. Kesimpulan.....	92
B. Saran	93
DAFTAR PUSTAKA	
LAMPIRAN - LAMPIRAN	

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Tingkat Konsumsi Masyarakat pada saat bulan Ramadhan	8
Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu.....	38
Tabel 3.1 Kriteria Pemilihan Sampel.....	47
Tabel 3.2 Sampel Perusahaan yang Terdaftar di JII Tahun 2018-2022	48
Tabel 3.3 Desain dan Definisi Operasional Variable	49
Tabel 4.1 <i>Window Dressing</i>	64
Tabel 4.2 <i>Ramadhan Effect</i>	66
Tabel 4.3 <i>Firm Size</i>	69
Tabel 4.4 Volatilitas Harga Saham	72
Tabel 4.5 Hasil Pengujian <i>Statistic Descriptive</i>	75
Tabel 4.6 Hasil Uji Normalitas <i>One Sampel Kolmogrov Smirnov</i>	77
Tabel 4.7 Hasil Uji Multikolinearitas	78
Tabel 4.8 Hasil Uji Heteroskedastisitas Glejser.....	79
Tabel 4.9 Hasil Uji Autokorelasi	80
Tabel 4.10 Hasil Uji Regresi Linear Berganda	80
Tabel 4.11 Hasil Uji T (Parsial).....	82
Tabel 4.12 Hasil Uji F (Stimulan)	84
Tabel 4.13 Hasil Uji Koefisien Determinasi (R^2)	84

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Jumlah Investor Tahun 2020-2023..... 2
Gambar 2.1 Bagan *Signalling Theory*..... 16
Gambar 2.2 Kerangka Berpikir 42
Gambar 4.1 Hasil Uji Normalitas (Metode P-Plot)..... 76
Gambar 4.2 Hasil Uji Normalitas (Metode Histogram)..... 77
Gambar 4.3 Kurva Penerimaan Hipotesis Dua Arah 83

