

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMBUNG	i
HALAMAN JUDUL	ii
HALAMAN PERSETUJUAN	iii
HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS	iv
KATA PENGANTAR	v
ABSTRAK	vii
ABSTRACT	viii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian	1
1.2 Latar Belakang Penelitian	2
1.3 Perumusan Masalah	8
1.4 Pertanyaan Penelitian	10
1.5 Tujuan Penelitian	10
1.6 Manfaat Penelitian	11
1.6.1 Aspek Teoritis	11
1.6.2 Aspek Praktis	11
1.7 Ruang Lingkup Penelitian	11
1.7.1 Lokasi dan Objek Penelitian	11
1.7.2 Waktu dan Periode Penelitian	12
1.8 Sistematika Penulisan Tugas Akhir	12
BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN LINGKUP PENELITIAN	15
2.1 Tinjauan Pustaka Penelitian	15
2.1.1 Tinjauan Teori	15
2.1.1.1 Investasi	15

2.1.1.2 Saham	16
2.1.1.3 Pasar Efisien	18
2.1.1.4 Anomali Pasar	19
2.1.1.5 Return Saham	22
2.1.2 Penelitian Terdahulu	23
2.2 Kerangka Pemikiran	31
2.3 Hipotesis Penelitian	32
BAB III METODE PENELITIAN	33
3.1 Karakteristik Penelitian	33
3.2 Alat Pengumpulan Data	34
3.3 Tahapan Pelaksanaan Penelitian	35
3.4 Populasi dan Sampel	39
3.5 Pengumpulan Data dan Sumber Data	40
3.6 Teknik Analisis Data dan Pengujian Hipotesis	41
3.6.1 Menghitung Return Saham	41
3.6.2 Uji Normalitas	41
3.6.3 Uji Statistik	42
3.6.4 Pengujian Hipotesis	43
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	45
4.1 Objek Penelitian	45
4.1.1 Bank Central Asia	45
4.1.2 Bank Danamon	49
4.1.3 Bank Tabungan Pensiunan Nasional	53
4.2 Hasil Penelitian	57
4.2.1 Bank Central Asia	57
4.2.2 Bank Danamon	59
4.2.3 Bank Tabungan Pensiunan Nasional	61
4.3 Pembahasan Hasil Penelitian	63
4.3.1 Bank Central Asia	63

4.3.2 Bank Danamon	64
4.3.3 Bank Tabungan Pensiunan Nasional	64
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	67
5.1 Kesimpulan	67
5.2 Saran	68
5.2.1 Aspek Teoritis	68
5.2.2 Aspek Praktisi	68
DAFTAR PUSTAKA	69