

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN SAMPUL</b> .....	i
<b>HALAMAN JUDUL</b> .....	ii
<b>HALAMAN PENGESAHAN</b> .....	iii
<b>HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS</b> .....	iv
<b>KATA PENGANTAR</b> .....	v
<b>ABSTRAK</b> .....	vii
<b>ABSTRACT</b> .....	viii
<b>DAFTAR ISI</b> .....	ix
<b>DAFTAR TABEL</b> .....	xiv
<b>DAFTAR GAMBAR</b> .....	xvi
<b>DAFTAR LAMPIRAN</b> .....	xvii
<b>BAB I PENDAHULUAN</b> .....	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian.....	1
1.2 Latar Belakang Penelitian.....	2
1.3 Perumusan Masalah.....	7
1.4 Pertanyaan Penelitian.....	9
1.5 Tujuan Penelitian.....	9
1.6 Manfaat Penelitian.....	9
1.7 Ruang Lingkup Penelitian.....	10
1.7.1 Lokasi dan Objek Penelitian.....	10
1.7.2 Waktu dan Periode Penelitian.....	10

1.8 Sistematika Penulisan Tugas Akhir.....	10
<b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN LINGKUP PENELITIAN.....</b>	<b>13</b>
2.1 Tinjauan Pustaka Penelitian.....	13
2.1.1 Landasan Teori.....	13
2.1.1.1 Investasi.....	13
2.1.1.2 Tujuan Investasi.....	14
2.1.1.3 Pasar Modal.....	14
2.1.1.4 Saham.....	15
2.1.1.5 <i>Return</i> Saham.....	17
2.1.1.6 Pasar Efisien.....	18
2.1.1.7 Anomali Pasar.....	18
2.1.2 Penelitian Terdahulu.....	19
2.2 Kerangka Pemikiran.....	23
2.3 Hipotesis Penelitian.....	24
<b>BAB III METODE PENELITIAN.....</b>	<b>27</b>
3.1 Karakteristik Penelitian.....	27
3.2 Alat Pengumpulan Data.....	28
3.3 Tahapan Penelitian.....	29
3.4 Populasi dan Sampel.....	32

3.4.1	Populasi.....	32
3.4.2	Sampel.....	32
3.5	Pengumpulan Data dan Sumber Data.....	33
3.5.1	Pengumpulan Data.....	33
3.5.2	Sumber Data.....	33
3.6	Teknik Analisis Data dan Pengujian Hipotesis.....	34
3.6.1	Menghitung <i>Return</i> Saham.....	34
3.6.2	Uji Normalitas.....	35
3.6.3	Uji Statistik.....	35
3.6.4	Pengujian Hipotesis.....	36
<b>BAB IV</b>	<b>HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....</b>	<b>39</b>
4.1	Karakteristik Responden.....	39
4.1.1	Bank Central Asia (BCA).....	39
4.1.2	Bank Danamon.....	43
4.1.3	Bank Tabungan Pensiunan Nasional (BTPN).....	48
4.2	Hasil Penelitian.....	52
4.2.1	Bank BCA.....	52
4.2.2	Bank Danamon.....	56
4.2.3	Bank BTPN.....	59

4.3 Pembahasan Hasil Penelitian.....	63
<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....</b>	<b>65</b>
5.1 Kesimpulan.....	65
5.2 Saran.....	66
<b>DAFTAR PUSTAKA.....</b>	<b>67</b>
<b>LAMPIRAN 1.....</b>	<b>72</b>
<b>LAMPIRAN 2.....</b>	<b>75</b>
<b>LAMPIRAN 3.....</b>	<b>78</b>
<b>LAMPIRAN 4.....</b>	<b>81</b>
<b>LAMPIRAN 5.....</b>	<b>83</b>
<b>LAMPIRAN 6.....</b>	<b>85</b>