

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMPUL	i
HALAMAN JUDUL	ii
HALAMAN PENGESAHAN	iii
HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS	iv
KATA PENGANTAR	v
ABSTRAK	vii
ABSTRACT	viii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR TABEL	xiv
DAFTAR GAMBAR	xvi
DAFTAR LAMPIRAN	xvii
BAB I PENDAHULUAN	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
BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN LINGKUP PENELITIAN.....	13
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
BAB III METODE PENELITIAN.....	27
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
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	39
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
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	65
5.1 Kesimpulan.....	65
5.2 Saran.....	66
DAFTAR PUSTAKA.....	67
LAMPIRAN 1.....	72
LAMPIRAN 2.....	75
LAMPIRAN 3.....	78
LAMPIRAN 4.....	81
LAMPIRAN 5.....	83
LAMPIRAN 6.....	85