

DAFTAR ISI

	halaman
KATA PENGANTAR	i
ABSTRAK	iii
DAFTAR ISI	iv
DAFTAR TABEL	vi
DAFTAR GAMBAR	vii
DAFTAR LAMPIRAN	viii
I. PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang	1
B. Tujuan Penelitian	4
II. LANDASAN TEORI	5
A. Model Random Walk	5
1. Pendahuluan	5
2. Penerapan Model Random Walk	7
B. Hipotesis Pasar Efisien	9
1. Pendahuluan	9
2. Syarat-syarat Pasar Saham Menjadi Efisien	11
3. Ciri-ciri Pasar Yang Efisien	11
4. Tanggapan Cepat dan Tepat Terhadap Informasi Baru ..	12
5. Bentuk Hipotesis Pasar Efisien	14
C. Perdebatan Hipotesis Pasar Efisien	14
D. Beberapa Studi Mengenai Pasar Modal Yang Efisien	16

III.	METODOLOGI PENELITIAN	17
	A. Kerangka Pikir Penelitian	17
	B. Hipotesis dan Definisi Operasional	18
	1. Hipotesis	18
	2. Definisi Operasional	18
	C. Tempat dan Waktu Penelitian	22
	D. Jenis dan Sumber Data	22
	E. Pengolahan dan Analisa Data	22
	1. Uji Larian (Run Test)	23
	2. Uji Kolmogorov-Smirnov	25
IV.	HASIL DAN PEMBAHASAN	26
	A. Hasil dan Analisa Uji Larian (Run Test)	26
	1. Hasil dan Analisa Uji Larian (Run Test) Tahun 1999 ..	26
	2. Hasil dan Analisa Uji Larian (Run Test) Tahun 2000 ..	30
	3. Hasil dan Analisa Uji Larian (Run Test) Tahun 2001 ..	33
	4. Hasil dan Analisa Uji Larian (Run Test) Tahun 1999-2001	37
	B. Hasil dan Analisa Uji Kolmogorov Smirnov	38
	1. Hasil dan Analisa Uji Kolmogorov-Smirnov Tahun 1999	38
	2. Hasil dan Analisa Uji Kolmogorov-Smirnov Tahun 2000	44
	3. Hasil dan Analisa Uji Kolmogorov-Smirnov Tahun 2001	50
	4. Hasil dan Analisa Uji Kolmogorov-Smirnov Tahun 1999-2001	55
V.	KESIMPULAN DAN SARAN	58
	A. Kesimpulan	58
	B. Saran	59
	DAFTAR PUSTAKA	60
	LAMPIRAN-LAMPIRAN	65