

DAFTAR ISI

	halaman
Halaman Judul	i
Lembar Pengesahan	ii
Lembar Pernyataan	iii
Prakata	iv
Abstrak	vi
Abstract	vii
Daftar Isi	viii
Daftar Tabel	x
Daftar Gambar	xii
Daftar Lampiran	xiii

BAB I. PENDAHULUAN

1.1. Latar Belakang Penelitian.....	1
1.2. Identifikasi Masalah	11
1.3. Batasan Masalah	12
1.4. Rumusan Masalah	13
1.5. Tujuan Penelitian	13
1.6. Manfaat Penelitian	14

BAB II. TINJAUAN PUSTAKA

2.1. Kajian Literatur	15
2.1.1. Pengertian Investasi.....	15
2.1.2. Proses Investasi.....	17
2.1.3. Jenis-Jenis Investasi.....	24
2.1.4. Saham.....	25
2.1.5. <i>Return</i> Saham.....	27
2.1.6. Indeks Harga Saham di Indonesia.....	29

2.1.7. Pasar Efisien dan Teori <i>Random Walk</i>	34
2.1.8. Pengujian Pasar Efisien Fama.....	51
2.2. Kajian Penelitian Terdahulu yang Relevan	60
BAB III. METODE PENELITIAN	
3.1. Kerangka Penelitian	64
3.2. Hipotesis Penelitian	66
3.3. Desain Penelitian	67
3.4. Definisi Operasional dan Pengukuran Variabel	67
3.5. Teknik Pengumpulan Data dan Pengambilan.....	69
3.6. Uji Kualitas Data	74
3.7. Metode Analisis	76
BAB IV. HASIL DAN PEMBAHASAN	
4.1. Gambaran Umum Obyek Penelitian	81
4.2. Pembahasan	85
4.2.1. Analisis Deskriptif	85
4.2.2. Hasil Uji Kualitas Data	87
4.2.3. Pengujian Hipotesis	95
4.2.4. Pembahasan Hasil Penelitian	96
BAB V. KESIMPULAN DAN SARAN	
5.1. Kesimpulan	99
5.2. Saran	100
DAFTAR PUSTAKA	102
DAFTAR LAMPIRAN.....	107