

Daftar Isi

Halaman Judul	i
Halaman Pengesahan	ii
Halaman Persetujuan	iii
Pernyataan Keaslian Karya Tulis	iv
Kata Pengantar	v
Daftar Isi.....	viii
Daftar Tabel	x
Daftar Gambar.....	xi
Daftar Lampiran	xii
Intisari	xiii
<i>Abstract</i>	xiv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Pertanyaan Penelitian	5
1.4 Tujuan Penelitian.....	6
1.5 Motivasi Penelitian.....	6
1.6 Manfaat Penelitian.....	7
1.7 Kontribusi Penelitian	7
1.8 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian.....	8
1.9 Sistematika Penulisan.....	8
BAB II LANDASAN TEORI DAN TINJAUAN PUSTAKA.....	10
2.1 Landasan Teori	10
2.1.1 Pasar Modal	10
2.1.2 Indeks Saham.....	12
2.1.3 Efisiensi Pasar Modal	15

2.1.4	<i>Adaptive Market Hypothesis</i>	17
2.1.5	Return.....	20
2.2	Tinjauan Pustaka dan Hipotesis	22
2.3	Hipotesis	26
BAB III METODE PENELITIAN		28
3.1	Desain Penelitian	28
3.2	Definisi Operasional Variabel	28
3.3	Populasi dan Sampel	31
3.4	Instrumen Penelitian.....	32
3.5	Teknik Pengumpulan Data	32
3.6	Teknik Analisis Data	33
3.6.1	Uji Stasioneritas (Augmented Dickey-Fuller Test)	33
3.6.2	Uji Efisiensi Pasar.....	35
3.6.3	Uji Regresi Linier Berganda (F Statistik)	36
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN		36
4.1	Pengujian Efisiensi	36
4.1.1	Statistik Deskriptif	36
4.1.2	Statistik Inferensi	39
4.2	Pengujian Pengaruh Makroekonomi	46
4.2.1	Statistik Deskriptif	47
4.2.2	Statistik Inferensi	48
BAB V SIMPULAN		53
5.1	Simpulan.....	53
5.2	Keterbatasan	55
5.3	Implikasi	56
5.3.1	Praktis.....	56
5.3.2	Teoritis	56
Daftar Pustaka		57