

## DAFTAR ISI

LEMBAR JUDUL.....	i
LEMBAR PENGESAHAN.....	ii
LEMBAR PERNYATAAN .....	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR GAMBAR .....	ix
DAFTAR LAMPIRAN.....	x
ABSTRAK .....	xi
<i>ABSTRACT</i> .....	xii
BAB I PENDAHULUAN .....	1
1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	8
1.3 Pertanyaan Penelitian .....	10
1.4 Tujuan Penelitian.....	10
1.5 Manfaat Penelitian.....	10
1.6 Lingkup Penelitian .....	11
1.7 Sistematika Penulisan.....	12
BAB II LANDASAN TEORI .....	13
2.1. Landasan Teori.....	13
2.1.1. Teori Efisiensi Pasar.....	13
2.1.2. Teori Informasi Asimetris .....	17
2.2. Kajian Penelitian Terdahulu.....	19
2.3. Perumusan Hipotesis .....	24
2.4. Model Penelitian .....	29
BAB III METODE PENELITIAN.....	30
3.1. Desain Penelitian.....	30
3.2. Metode Pengumpulan Data.....	30
3.3. Instrumen Penelitian.....	32
3.3.1. Definisi Operasional.....	32
3.3.2. Pengembangan Instrumen dan Metode Pengukuran .....	35

3.4. Metode Analisa Data.....	40
Bab IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	42
4.1. Deskripsi Data dan Sampel Data.....	42
4.2. Pergerakan Harga dan Return .....	42
4.3. Statistik Deskriptif Faktor Fundamental Perusahaan .....	42
4.4. Pengujian Hipotesis.....	46
4.5. Uji Asumsi Klasik .....	53
4.6. Diskusi dan Pembahasan.....	55
Bab V SIMPULAN .....	60
5.1. Simpulan.....	60
5.2. Implikasi.....	61
5.3. Keterbatasan .....	62
5.4. Saran.....	62
DAFTAR PUSTAKA .....	64
LAMPIRAN .....	67