



DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
MOTTO.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR ISI.....	vii
INTISARI.....	ix
ABSTRACT.....	x
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang Penelitian.....	1
1.2 Perumusan Masalah.....	6
1.3 Keaslian Penelitian.....	6
1.4 Tujuan Penelitian.....	8
1.5 Manfaat Penelitian.....	9
1.6 Sistematika Penelitian.....	9
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	
2.1 Pengertian Pasar Modal.....	12
2.2 Investasi.....	13
2.3 Pasar Modal yang Efisien.....	17



2.4 Risiko dan Return.....	20
2.5 Holding Period.....	22
2.6 Firm Size.....	23
2.7 Price to Book Value.....	24
2.7 Price Earning Ratio.....	29
BAB III METODE PENELITIAN	
3.1 Data.....	32
3.2 Pemilihan Sampel.....	33
3.3 Identifikasi Variabel Penelitian.....	35
3.4 Metode Analisis Data.....	37
BAB IV HASIL ANALISIS DAN PEMBAHASAN	
4.1 Pembahasan Hasil Pengujian Hipotesis I.....	41
4.2 Pembahasan Hasil Pengujian Hipotesis II.....	43
4.3 Pembahasan Hasil Pengujian Hipotesis III.....	47
4.4 Pembahasan Hasil Pengujian Hipotesis IV.....	51
BAB V KESIMPULAN, KETERBATASAN, SARAN	
5.1 Kesimpulan.....	57
5.2 Keterbatasan.....	58
5.3 Saran.....	59
DAFTAR PUSTAKA.....	60
LAMPIRAN.....	64