

DAFTAR ISI

	Halaman
Halaman Judul	i
Surat Pernyataan Keaslian Tesis	ii
Pengesahan Tesis	iii
<i>Abstract</i>	iv
Abstraksi	v
Kata Pengantar	vi
Daftar Tabel	xi
Daftar Gambar	xii
Daftar Lampiran	xiii
 BAB I : PENDAHULUAN	
1.1. Latar Belakang Penelitian	1
1.2. Perumusan Masalah	3
1.3. Tujuan dan Kegunaan Penelitian	4
 BAB II : TELAAH PUSTAKA DAN HIPOTESIS	
2.1. Telaah Pustaka	6
2.1.1. Price Earning Ratio (PER)	6
2.1.2 Hipotesa Pasar Efisien (<i>Efficient Market Hypothesis</i>)	8
2.1.3. Anomali pada Hipotesa Pasar Efisien	22
2.1.4. Efek PER rendah (<i>Low P/E Effect</i>)	29
2.2. Penelitian Terdahulu	30

2.3. Pengembangan Model dan Kerangka Pemikiran Teoritis	40
2.3.1. Kerangka Pemikiran Teoritis	40
2.3.2. Hipotesis	42
BAB III : METODE PENELITIAN	
3.1. Jenis dan Sumber data	45
3.2. Populasi dan Sampel	45
3.3. Definisi Operasional Variabel	46
3.4. Teknik Analisis	48
BAB IV : ANALISIS DATA	
4.1. Gambaran Umum Obyek Penelitian dan Data Deskriptif	52
4.1.1. Obyek Penelitian	52
4.1.2. Data Deskriptif	52
4.2. Proses dan Hasil Analisis	53
4.2.1. Purposive Sampling	53
4.2.2. Pemilihan Sample Portfolio	53
4.2.3. Perhitungan <i>risk adjusted rate of return</i>	54
4.3. Pengujian Hipotesis	55
4.3.1. Hipotesis a,b, dan c	55
4.3.2. Hipotesis d	57
4.4. Kesimpulan Bab	58
BAB V : KESIMPULAN DAN IMPLIKASI KEBIJAKAN	
5.1. Kesimpulan	59
5.2. Implikasi Kebijakan	59

5.2.1. Implikasi Teoritis	59
5.2.2. Implikasi terhadap praktek pasar modal indonesia	59
5.3. Keterbatasan Penelitian	60
5.4. Agenda Penelitian Mendatang	60

DAFTAR REFERENSI

LAMPIRAN-LAMPIRAN