

## DAFTAR ISI

	<b>Halaman</b>
HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS.....	ii
HALAMAN PERSETUJUAN.....	iii
HALAMAN PENGESAHAN .....	iv
HALAMAN RIWAYAT HDUP.....	v
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	vi
HALAMAN MOTTO .....	viii
ABSTRAK INDONESIA .....	ix
KATA PENGANTAR .....	xii
DAFTAR ISI.....	xiv
 <b>BAB I PENDAHULUAN</b>	
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	8
1.3 Ruang Lingkup Penelitian .....	9
1.4 Tujuan Penelitian.....	9
1.5 Manfaat Penelitian.....	10
1.6 Sistematika Penulisan .....	10
 <b>BAB II LANDASAN TEORI</b>	
2.1 Teori Efisiensi Pasar .....	12
2.2 Pasar Modal .....	13
2.3 Saham .....	15
2.4 <i>Book to Market Ratio</i> .....	17
2.5 <i>Market Capitalization</i> .....	19
2.6 Penelitian Terdahulu.....	20

2.7 Kerangka Pikir.....	21
2.8 Pengembangan Hipotesis.....	21

### **BAB III METODE PENELITIAN**

3.1 Jenis Penelitian .....	24
3.2 Sumber Data .....	24
3.3 Metode Pengumpulan Data .....	24
3.4 Populasi dan Sampel.....	25
3.4.1 Populasi .....	25
3.4.2 Sampel .....	26
3.5 Variabel Penelitian.....	26
3.6 Definisi Operasional Variabel .....	28
3.7 Metode Estimasi Data Panel.....	29
3.8 Uji Asumsi Klasik .....	32
3.9 Analisis Regresi Data Panel.....	33

### **BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN**

4.1 Gambaran Umum Objek Penelitian.....	36
4.2 Analisis Data.....	43
4.2.1 Hasil Statistik Deskriptif .....	43
4.3 Pemilihan Model Regresi Data Panel .....	44
4.4 Uji Asumsi Klasik .....	46
4.5 Model Regresi Linier Berganda.....	48
4.6 Pengujian Hipotesis .....	49
4.7 Pembahasan .....	50

### **BAB V SIMPULAN DAN SARAN**

5.1 Simpulan.....	55
-------------------	----

5.2 Saran .....	55
-----------------	----

**DAFTAR PUSTAKA**

**LAMPIRAN**

## DAFTAR TABEL

<b>Tabel</b>	<b>Halaman</b>
2.1 Penelitian Terdahulu .....	20
3.1 Kriteria Sampel .....	26
3.2 Definisi Operasional Variabel.....	28
4.1 Daftar Perusahaan yang diteliti .....	36
4.2 Hasil Uji Deskriptif statistik.....	43
4.3 Hasil Uji Chow.....	45
4.4 Hasil Uji Hausman .....	46
4.5 Hasil Uji Normalitas Data.....	46
4.6 Hasil Uji Multikolinearitas.....	47
4.7 Hasil Uji Autokorelasi.....	47
4.8 Hasil Persamaan Analisis Regresi Linier Berganda.....	48

## DAFTAR GAMBAR

<b>Gambar</b>	<b>Halaman</b>
1.1 Harga Saham indeks LQ45 Pada Saat Kondisi Pandemi Covid-19.....	5
2.1 Kerangka Pikir .....	21
4.1 Kriteria Autokorelasi.....	48