

DAFTAR ISI

ABSTRAK	i
ABSTRACT	ii
LEMBAR PENGESAHAN	iii
LEMBAR PERNYATAAN	iv
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR GAMBAR.....	viii
DAFTAR TABEL	ix
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Identifikasi, Perumusan, dan Batasan Masalah.....	6
1.2.1. Identifikasi Masalah	6
1.2.2. Rumusan Masalah.....	6
1.3. Maksud dan Tujuan	7
1.3.1. Maksud Penelitian.....	7
1.3.2. Tujuan Penelitian	7
1.4. Manfaat dan Kegunaan Penelitian	7
1.4.1. Manfaat Penelitian.....	7
1.4.2. Kegunaan Penelitian.....	7
BAB II DESKRIPSI PERUSAHAAN	8
2.1. Sejarah Perusahaan	8
2.2. Lingkup dan Bidang Usaha	10
2.3. Tantangan Bisnis.....	10
BAB III KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN, DAN HIPOTESIS.....	12
3.1. Kajian Teori.....	12
3.1.1. <i>Rational Expectation Hypothesis</i>	12
3.1.2. <i>Efficient Market Hypothesis</i>	14
3.1.3. <i>Capital Asset Pricing Model (CAPM)</i>	16
3.1.4. <i>Auto Regressive Integrated Moving Average (ARIMA)</i>	17

3.2.	Penelitian Terdahulu	19
3.3.	Kerangka Pemikiran	20
3.4.	Hipotesis.....	22
BAB IV METODE PENELITIAN		23
4.1.	Desain Penelitian	23
4.2.	Variabel Penelitian.....	23
4.2.1.	Definisi Konsep	24
4.2.2.	Definisi Operasional.....	24
4.3.	Jenis dan Sumber Data	25
4.4.	Teknik Pengumpulan Data	25
4.5.	Teknik Analisis Data.....	25
4.5.1.	Analisis Data Deskriptif	25
4.5.2.	Stasioneritas Data.....	26
4.5.3.	Langkah Analisis	26
BAB V HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN		30
5.1.	Identifikasi Model.....	30
5.1.1.	Plot <i>Time Series</i>	30
5.1.2.	Uji Stasioneritas	32
5.2.	Estimasi Parameter dan Prediksi	39
5.3.	Perbandingan Prediksi Pertumbuhan BBRI dan IHSG, serta Pembahasannya	45
BAB VI SIMPULAN DAN SARAN		50
6.1.	Simpulan	50
6.2.	Saran	51
DAFTAR PUSTAKA		52