

DAFTAR ISI

DAFTAR ISI	ii
DAFTAR TABEL.....	iv
DAFTAR GAMBAR	v
DAFTAR LAMPIRAN	vi
I. PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	9
1.3. Tujuan dan Manfaat Penelitian	9
1.4. Kerangka Teoritis.....	10
II. LANDASAN TEORI.....	12
2.1. Teori Pasar Modal	12
2.2. Teori Investasi	17
2.3. Teori Portofolio.....	22
2.4. Konsep <i>Return</i> dan Risiko	26
2.5. <i>Excess Return to Beta</i>	29
2.6. Portofolio Efisien dan Portofolio Optimal	30
2.7. Indeks LQ-45	34
2.8. Penelitian Terdahulu	35
III. METODOLOGI PENELITIAN	39
3.1. Jenis dan Sumber Data.....	39
3.2. Populasi dan Sampel	39
3.3. Penilaian Kinerja Portofolio.....	40
3.4. Metode Pengumpulan Data.....	41
3.5. Alat Analisis.....	42
3.6. Model Analisis Data.....	42

IV.	HASIL DAN PEMBAHASAN	46
4.1.	Penentuan Objek Penelitian	46
4.2.	Analisis Statistik Deskriptif Data Indeks Saham Per Sektor LQ-45.....	46
4.2.1.	Tingkat Pengembalian Saham	46
4.2.2.	Tingkat Risiko Saham	49
4.3.	Pembentukan Portofolio Efisien	50
4.3.1.	<i>Excess Return to Beta</i> (ERB) Per Sektor.....	50
4.3.2.	<i>Cutt-off Point</i> (C*) Per Sektor.....	52
4.3.3.	Menentukan <i>Cutt-off Point</i> (C*).....	53
4.3.4.	Menghitung Proporsi dan Presentase Per Sektor	54
4.3.5.	<i>Expected Return</i> dan Risiko Portofolio Per Sektor.....	55
4.4.	Pemilihan Portofolio Optimal	56
4.4.1.	<i>Excess Return to Beta</i> (ERB) Masing-masing Saham.....	58
4.4.2.	<i>Cutt-off Point</i> (C*) Masing-masing Saham.....	61
4.4.3.	Menentukan <i>Cutt-off Point</i> (C*).....	62
4.4.4.	Menghitung Proporsi dan Presentase Masing-masing Saham	62
4.4.5.	<i>Expected Return</i> dan Risiko Portofolio Per Saham.....	63
V.	KESIMPULAN DAN SARAN	65
5.1.	Kesimpulan	65
5.2.	Saran.....	66

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN