

DAFTAR ISI

LEMBAR PERNYATAAN	i
KATA PENGANTAR	ii
ABSTRAK	iv
ABSTRACT	v
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR GAMBAR	viii
DAFTAR TABEL	ix
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian.....	1
1.1.1 <i>Single Index Model</i>	1
1.1.2 Indeks LQ45.....	1
1.1.3 PT Manulife Aset Manajemen Indonesia	1
1.2 Latar Belakang Penelitian	3
1.3 Perumusan Masalah.....	7
1.4 Tujuan Penelitian.....	9
1.5 Kegunaan Penelitian	10
1.6 Sistematika Penulisan	11
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	12
2.1 Tinjauan Pustaka	12
2.1.1 Pengertian Investasi.....	12
2.1.2 Pengertian Saham	13
2.1.3 Teori Portofolio	14
2.2 <i>Single Index Model</i>	16
2.2 Perhitungan Kinerja Portofolio	22
2.3 Reksadana	24
2.4 Penelitian Terdahulu.....	26
2.5 Kerangka Pemikiran	28
2.6 Hipotesis	30
BAB III METODE PENELITIAN	32
3.1 Jenis Penelitian.....	32
3.2 Variabel Penelitian	33
3.3 Operasional Variabel	33
3.4 Jenis dan Sumber Data.....	35

3.5 Populasi dan Sampel.....	36
3.6 Metode Analisis.....	36
3.7 Rancangan Pengujian Hipotesis.....	37
3.7.1 Uji Normalitas Data.....	37
3.7.2 <i>Independent Sample t-test</i>	37
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	42
4.1 Pemilihan Saham Kandidat Portofolio	42
4.2 Pemilihan Reksadana.....	44
4.3 Penyusunan Portofolio Saham Optimum dengan <i>Single Index Model</i>	45
4.3.1 Variabel-variabel yang Diperlukan dalam Penyusunan <i>Single Index Model</i>	45
4.3.2 Tahapan Penyusunan Portofolio Saham Optimal Dengan <i>Single Index Model</i>	52
4.3.3 <i>Expected Return</i> dan Risiko Portofolio Saham Optimal yang Dibentuk Dengan Menggunakan <i>Single Index Model</i>	64
4.4 <i>Expected Return</i> dan Risiko Reksadana	64
4.4.1 <i>Expected Return</i> Reksadana	64
4.4.2 Risiko Reksadana	65
4.5 Evaluasi Kinerja Portofolio.....	66
4.6 Pengujian Hipotesis	69
4.6.1 Uji Normalitas.....	69
4.6.2 <i>Independent Sample t-test</i>	71
4.7 Pembahasan Hasil Penelitian	80
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	82
5.1 Kesimpulan	82
5.2 Saran... ..	83
DAFTAR PUSTAKA	85