

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
ABSTRAK	iv
ABSTRACT	vii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian	1
1.2 Latar Belakang Penelitian	2
1.3 Perumusan Masalah	13
1.4 Tujuan Penelitian	13
1.5 Manfaat Penelitian	14
1.6 Sistematika Penulisan Tugas Akhir	14
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	16
2.1 Teori dan Penelitian Terdahulu.....	16
2.1.1 Teori Pasar Modal	16
2.1.2 Teori Investasi.....	16
2.1.3 Pengertian Saham.....	17
2.1.4 Risiko dan <i>Return</i>	17
2.1.5 Teori dan Pembentukan Portofolio	18
2.1.6 Model Indeks Tunggal	20
2.1.7 Model Indeks Tunggal dalam Pembentukan Portofolio Optimal	21

2.1.8 Teori <i>Capital Asset Pricing Model</i> (CAPM)	23
2.1.9 <i>Capital Asset Pricing Model</i> (CAPM) dalam Pembentukan Portofolio Optimal.....	24
2.1.10 Evaluasi Kinerja Portofolio Optimal.....	25
2.1.11 Penelitian Terdahulu	27
2.2 Kerangka Pemikiran	44
BAB III METODE PENELITIAN	45
3.1 Jenis Penelitian	45
3.2 Operasionalisasi Variabel.....	46
3.3 Tahapan Penelitian	48
3.4 Populasi dan Sampel	49
3.5 Pengumpulan Data dan Sumber Data	52
3.6 Teknik Analisis Data.....	53
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	55
4.1 Hasil Penelitian	55
4.1.1 Pembentukan Portofolio Optimal dengan Model Indeks Tunggal.....	55
4.1.2 Pembentukan Portofolio Optimal dengan <i>Capital Asset Pricing Model</i>	78
4.1.3 Evaluasi Kinerja Pembentukan Portofolio	91
4.2 Pembahasan Hasil Penelitian	94
4.2.1 Pembentukan Portofolio dengan Model Indeks Tunggal	94
4.2.2 Pembentukan Portofolio dengan CAPM.....	96
4.2.3 Evaluasi Perbandingan Kinerja Pembentukan Portofolio Model Indeks Tunggal dan CAPM.....	98

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	101
5.1 Kesimpulan	101
5.2 Saran.....	102
5.2.1 Saran Teoritis	102
5.2.2 Saran Praktis	102
DAFTAR PUSTAKA.....	104
LAMPIRAN.....	107