

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
ABSTRAK	v
ABSTRACT	vi
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR GAMBAR.....	ix
DAFTAR TABEL	x
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian.....	1
1.2 Latar Belakang Penelitian.....	2
1.3 Perumusan Masalah	16
1.4 Tujuan Penelitian	17
1.5 Manfaat Penelitian	17
1.6 Sistematika Penulisan	18
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	19
2.1 Teori-teori Terkait Penelitian Terdahulu	19
2.1.1 Investasi	19
2.1.2 Saham	23
2.1.3 Beta Saham	24
2.1.4 Portofolio Investasi.....	27
2.1.5 Kajian Penelitian Terdahulu	31
2.2 Kerangka Pemikiran	44
.....	45
BAB III METODE PENELITIAN	46
3.1 Jenis Penelitian	46
3.2 Operasional Variabel	47
3.3 Tahapan Penelitian.....	47

3.4 Populasi dan Sampel.....	49
3.5 Pengumpulan Data dan Sumber Data	51
3.6 Teknis Analisis Data.....	51
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	53
4.1 Karakteristik Data	53
4.2 Hasil Penelitian.....	53
4.2.1 Menghitung Tingkat Pengembalian Saham Individu	53
4.2.2 Menghitung Tingkat Risiko Saham individu	55
4.2.3 Menghitung Beta Saham Individu.....	55
4.2.4 Menghitung Risiko Tidak Sistematis	57
4.2.5 Menentukan <i>Risk Free Rate</i>	58
4.2.6 Menentukan Kelompok Beta Saham Terpilih	60
4.2.7 Membentuk Portofolio untuk Strategi Pasif dan Strategi Aktif ..	61
4.2.8 Menentukan Pembobotan Saham Pada Tiap Portofolio	62
4.2.9 Menghitung Beta Portofolio	79
4.2.10 Menghitung Risiko Tidak Sistematis Portofolio	81
4.2.11 Menghitung <i>Return</i> dan Risiko Portofolio	82
4.2.12 Evaluasi Kinerja Portofolio Strategi Aktif dan Strategi Pasif ...	85
4.3 Pembahasan Hasil Penelitian.....	86
4.3.1 Pembahasan Kelompok Beta Terpilih	87
4.3.2 Pembahasan Strategi Investasi Terbaik	87
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	90
5.1 Kesimpulan	90
5.2 Saran	90
5.2.1 Aspek Teoritis	90
5.2.2 Aspek Praktis.....	91
DAFTAR PUSTAKA	93
BIODATA	101
LAMPIRAN.....	102