

DAFTAR ISI

ABSTRACT	i
ABSTRAK	ii
LEMBAR PENGESAHAN	iii
LEMBAR PERNYATAAN	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GRAFIK	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB I. PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Identifikasi, Perumusan, dan Batasan Masalah	7
1.2.1 Identifikasi Masalah	7
1.2.2 Perumusan Masalah	8
1.2.3 Batasan Masalah.....	9
1.3 Maksud dan Tujuan Penelitian	9
1.4 Manfaat dan Kegunaan Penelitian	10
BAB II. DESKRIPSI INFOBANK15 DAN BISNIS-27	
2.1 Indeks infobank15	11
2.2 Indeks BISNIS-27	13
BAB III. KAJIAN PUSTAKA DAN KERANGKA PEMIKIRAN	
3.1 Investasi	15
3.2 Pasar Modal	16
3.3 Indeks Harga Saham	17
3.4 Portofolio	17

3.5 Model Indeks Tunggal (<i>Single Index Model</i>)	19
3.6 Analisis Kinerja Portofolio.....	22
3.6.1 Indeks Sharpe.....	24
3.6.2 Indeks Treynor	25
3.6.3 Indeks Jensen	26
3.7 Penelitian Terdahulu	28
3.8 Kerangka Pemikiran	32

BAB IV. METODE PENELITIAN

4.1 Jenis Penelitian	33
4.2 Variabel dan Pengukuran Variabel	33
4.3 Populasi dan Sampel	34
4.4 Jenis dan Sumber Data	36
4.5 Teknik Pengumpulan Data	36
4.6 Teknik Analisis Data	37

BAB V. HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

5.1 Analisis <i>Single Index Model</i>	42
5.1.1 Analisis Imbal Hasil Saham Individu	42
5.1.2 Analisis Imbal Hasil Pasar	45
5.1.3 Analisis <i>Alpha</i> , <i>Beta</i> , dan <i>Variance Residual Error</i> Saham Individu	48
5.1.4 Analisis Nilai <i>Excess Return to Beta</i>	51
5.1.5 Analisis Nilai <i>Cut Off Point</i>	53
5.1.6 Skala Tertimbang dan Proporsi Dana Saham Pembentuk Portofolio Optimal	55
5.1.7 Mengukur Ekspekstasi Imbal Hasil dan Risiko Portofolio	57
5.2 Analisis <i>Risk Adjusted Performance</i>	60
5.3 Pembahasan	63

BAB VI. KESIMPULAN DAN SARAN	
6.1 Kesimpulan	65
6.2 Saran	66
DAFTAR PUSTAKA	68
LAMPIRAN	73
DAFTAR RIWAYAT HIDUP.....	107



UNIVERSITAS
MERCU BUANA