

## DAFTAR ISI

	Halaman
<b>HALAMAN JUDUL</b>	i
<b>SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI</b>	ii
<b>LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI</b>	iii
<b>ABSTRAK</b>	iv
<b>ABSTRACT</b>	v
<b>KATA PENGANTAR</b>	vi
<b>DAFTAR ISI</b>	vii
<b>DAFTAR TABEL</b>	ix
<b>DAFTAR GAMBAR</b>	x
<b>DAFTAR LAMPIRAN</b>	xi
<b>BAB I PENDAHULUAN</b>	1
A. Latar Belakang Penelitian	1
B. Rumusan Masalah	8
C. Tujuan Penelitian	8
D. Kontribusi Penelitian	9
<b>BAB II KAJIAN PUSTAKA DAN KERANGKA PEMIKIRAN</b>	10
A. Kajian Pustaka	10
1. Investasi	10
a. Pengertian Investasi	10
b. Proses Investasi	10
2. Pasar Modal	12
a. Pengertian Pasar Modal	12
b. Instrument Pasar Modal	12
3. Indeks Harga Saham	14
4. <i>Return</i> Investasi	15
5. Risiko Investasi	16
6. Portofolio	17
a. Teori Portofolio	17
b. Portofolio Efisien	18
c. Portofolio Optimal	18
d. Menghitung <i>Return</i> dan Risiko Portofolio	19
7. Model Indeks Tunggal ( <i>Single Index Model</i> )	20
8. Indeks JII	21
B. Penelitian Terdahulu	23
C. Kerangka Pemikiran	27
<b>BAB III METODE PENELITIAN</b>	28
A. Waktu dan Tempat Penelitian	28
B. Desain Penelitian	28
C. Definisi dan Operasional Variabel	28
D. Populasi dan Sampel Penelitian	31

1. Populasi Penelitian	31
2. Sampel Penelitian	31
E. Metode Pengumpulan Data	32
F. Metode Analisis Data	33
<b>BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN</b>	<b>38</b>
A. Gambaran Umum Obyek Penelitian	38
B. Analisis Data	39
1. Analisis Perhitungan <i>Return</i> Saham Individu , <i>Expected Return</i> , Standar Deviasi, dan Varian Saham Individu	39
2. Analisis Perhitungan <i>Return Market</i>	41
3. Analisis Perhitungan <i>Alpha</i> , <i>Beta</i> , dan <i>Variance Residual Error Individu</i>	43
4. Analisis Perhitungan <i>Excess Return to Beta (ERB)</i>	45
5. Analisis Perhitungan Nilai <i>Cut Off Point</i>	46
6. Analisis Perhitungan Skala Tertimbang dan Proporsi Dana Saham Pembentuk Portofolio Optimal	47
7. Analisis Perhitungan <i>Expected Return</i> Portofolio	48
8. Analisis Perhitungan Risiko Portofolio	49
9. Pembentukan kurva <i>efficient frontier</i>	50
C. Pembahasan	51
<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN</b>	<b>54</b>
A. Kesimpulan	54
B. Saran	55
<b>DAFTAR PUSTAKA</b>	<b>56</b>
<b>LAMPIRAN</b>	<b>61</b>