

DAFTAR ISI

ABSTRACT	i
ABSTRAK	ii
PENGESAHAN	iii
PERNYATAAN	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR SINGKATAN	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
BAB I. PENDAHULUAN	
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	5
1.3. Maksud dan Tujuan	5
1.4. Pembatasan Masalah	6
1.5. Manfaat dan Kegunaan Riset	6
1.6. Sistematika Penulisan	7
BAB II. DESKRIPSI BURSA EFEK INDONESIA	
2.1. Sejarah Bursa Efek Indonesia	9
2.2. Pasar Modal	13

2.2.1. Saham	13
2.2.2. Deviden	14
2.2.3. Capital Gain	14
2.2.4. Risiko Likuidasi	14
2.2.5. Mekanisme Perdagangan BEI	15
2.3. Indeks Harga Saham Gabungan	16
2.4. Indeks LQ45	21
2.5. Jakarta Islamic Index	23
2.6. Indeks Bisnis-27	26

BAB III. KAJIAN PUSTAKA DAN KERANGKA PEMIKIRAN

3.1. Riset Sebelumnya	29
3.2. Investasi	29
3.2.1. Saham	32
3.2.2. Analisa Saham	35
3.2.3. Return dan Risiko	38
3.2.4. Pengertian Beta	39
3.3. Teori Portofolio	40
3.3.1. Return dan Risiko Portofolio	42
3.3.2. Prinsip diversifikasi	44
3.3.3. Pemilihan Portofolio	46
3.4. Model Indeks Tunggal	49
3.4.1. Asumsi Model Indeks Tunggal	49
3.4.2. Parameter yang digunakan	50

3.5. Analisis Kinerja Portofolio	54
3.5.1. Indeks Treynor	54
3.5.2. Indeks Sharpe	55
3.5.3. Indeks Jensen	56
3.6. Rerangka Pemikiran	58
3.7. Uji Hipotesis (Uji Beda)	58

BAB IV. METODE Riset

4.1. Objek Riset	60
4.2. Metode Riset	60
4.2.1. Teknik Pengumpulan Data	62
4.2.2. Metode Analisis	62
4.2.3. Tahapan Pengolahan Data	63
4.2.4. Perhitungan Kinerja Portofolio	68
4.2.4.1. Indeks Treynor	68
4.2.4.2. Indeks Sharpe	69
4.2.4.3. Indeks Jensen	69

BAB V. HASIL DAN ANALISIS

5.1. Pemilihan Awal Daftar Saham Pada Indeks LQ45, JII dan Bisnis-27 Tahun 2009	70
5.2. Pembentukan Portofolio Optimal LQ45, JII dan Bisnis-27	73
5.3. Pengamatan Investasi Portofolio Optimal LQ45, JII dan Bisnis-27	76

5.4. Analisis Kinerja Portofolio Optimal	
LQ45, <i>JII</i> dan <i>Bisnis-27</i>	78
5.5. Uji Beda (<i>Compare Mean</i>) Kinerja Portofolio Optimal	81
BAB VI. KESIMPULAN DAN REKOMENDASI	86
6.1. Kesimpulan	86
6.2. Rekomendasi	87
DAFTAR PUSTAKA	88
LAMPIRAN	90
RIWAYAT HIDUP	141

