

DAFTAR ISI

ABSTRACT	i
LEMBAR PENGESAHAN	iii
LEMBAR PERNYATAAN	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Perumusan Masalah.....	6
1.3 Tujuan Penelitian (Maksud & Tujuan).....	6
1.4 Kegunaan Penelitian.....	6
BAB II DESKRIPSI OBJEK PENELITIAN	8
2.1 Objek Penelitian.....	8
2.2 Pasar Modal.....	8
2.3. Saham.....	10
BAB III KAJIAN PUSTAKA, RERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESA	15
3.1 Tinjauan teoritis.....	15
a. Portofolio Markowitz.....	15

b. Portofolio Optimal.....	18
c. Capital Asset Pricing Model (CAPM).....	19
d. Capital Market Line.....	20
e. Security Market Line.....	21
f. Beta sebagai pengukur resiko.....	22
g. Theory Fama dan French.....	23
3.2. Penelitian Terdahulu.....	31
3.3. Rerangka Pemikiran.....	34
3.4. Hipotesis.....	35
BAB IV METODOLOGI RISET	36
4.1. Objek Riset.....	36
4.2. Metode Riset.....	36
a. Populasi dan Sample Penelitian.....	36
b. Defenisi dan Pengukuran Variabel Penelitian.....	38
1.) Imbal Hasil.....	38
2.) Imbal Hasil Portofolio Pasar.....	38
3.) Ukuran Perusahaan.....	39
4.) Nilai Perusahaan.....	40
4.3. Metodologi Analisis Data.....	41
1). Teknik Pengumpulan Data.....	41
2). Metode Analisis Data.....	42
3). Formasi Portofolio.....	43
4). Uji Hipotesis.....	43

BAB V HASIL DAN ANALISIS.....	45
BAB VI KESIMPULAN DAN SARAN.....	94
6.1. Kesimpulan.....	94
6.2. Saran.....	95
DAFTAR PUSTAKA.....	96
LAMPIRAN.....	98
DAFTAR RIWAYAT HIDUP.....	120

