

DAFTAR ISI

KATA PENGANTAR.....	i
ABSTRAK	ii
<i>ABSTRACT</i>	iii
DAFTAR ISI.....	iv
DAFTAR GAMBAR.....	vi
DAFTAR TABEL	vii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	8
1.3 Tujuan Penulisan	8
1.4 Kontribusi Penulisan	8
1.5 Signifikansi Penelitian	9
1.6 Batasan Penelitian.....	9
1.7 Sistematika Penulisan	10
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA	11
2.1 Investasi	11
2.2 Portofolio Investasi	13
2.3 Saham	14
2.4 Tingkat Pengembalian dan Risiko Saham	15
2.5 Markowitz Model.....	16
2.6 Single Index Model	18
2.7 Pengukuran Kinerja Portofolio	18
2.7 Kerangka Konsep Penelitian	19
BAB III Metode Penelitian	21
3.1 Jenis Penelitian.....	21

3.2 Kriteria Pemilihan Sampel	21
3.3 Pengolahan Data	26
3.3.1 Seleksi Saham	26
3.3.2 Single Index Model.....	31
3.3.3 <i>Markowitz Model</i>	32
3.3.4 Pengukuran Performa Portofolio	33
BAB 4 ANALISA DAN PEMBAHASAN	35
4.1 Pembentukan Portofolio Optimal	35
4.1.1 Seleksi Saham	35
4.1.2 Pembentukan Portofolio Menggunakan <i>Single Index Model</i>	46
4.1.3 Pembentukan Portofolio Menggunakan Markowitz Model	49
4.2 Pengukuran Performa Portofolio.....	50
4.3 Saran Untuk Investor	56
BAB V KESIMPULAN.....	57
5.1 Kesimpulan	57
5.2 Saran.....	59
DAFTAR PUSTAKA.....	60
LAMPIRAN.....	66
Lampiran 1 Perhitungan Nilai ERB	66
Lampiran 2 Perhitungan Nilai Cut-off Rate (C*).....	82
Lampiran 3 Perhitungan Nilai Z	91