

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMBUNG.....	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERSETUJUAN	iii
HALAMAN MOTTO DAN PERSEMBAHAN	iv
HALAMAN PERNYATAAN.....	v
KATA PENGANTAR	vii
<i>ABSTRACT</i>	x
ABSTRAK	xi
INTISARI	xii
DAFTAR ISI	xiii
DAFTAR TABEL	xv
DAFTAR GAMBAR	xvii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xviii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang Masalah.....	1
1.2. Rumusan Masalah	6
1.3. Tujuan Penelitian	7
1.4. Manfaat.....	8
BAB II KAJIAN PUSTAKA	9
2.1. Investasi	9
2.1.1 Return	10
2.1.2 Risiko	11
2.2. Indeks Harga Saham	12

2.3.	Portofolio Optimal dan Tidak Optimal	14
2.3.1	<i>Single index model</i>	17
2.4.	Penelitian Terdahulu dan Perumusan Hipotesis	18
2.5.	Model Pemikiran	21
BAB III METODE PENELITIAN		22
3.1.	Jenis Penelitian.....	22
3.2.	Populasi dan Sampel	22
3.3.	Jenis dan Sumber Data	24
3.4.	Metode Pengumpulan Data.....	25
3.5.	Variabel dan Definisi Operasional	26
3.6.	Teknik Analisis Data	35
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN		39
4.1.	Gambaran Umum Objek Penelitian	39
4.2.	Analisis Portofolio <i>Single Index Model</i>	40
4.3.	Analisis Statistik Uji Beda Rata-Rata	52
4.4.	Pembahasan	61
BAB V PENUTUP		68
5.1.	Simpulan.....	68
5.2.	Saran	69
5.3.	Keterbatasan peneliti	70
DAFTAR PUSTAKA		71

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1. Kinerja Indeks Kompas 100 Tahun 2011-2015	4
Tabel 3.1. Daftar Perusahaan Sampel Indeks Kompas 100 Periode 2011-2015 ...	24
Tabel 3.2. Definisi Operasional dan Pengukuran Variabel Penelitian.....	34
Tabel 4.1. Sampel Penelitian	40
Tabel 4.2. Return, Risiko Dan Beta Individu Sampel Penelitian	42
Tabel 4.3. Nilai ERB Sampel Penelitian	44
Tabel 4.4. Nilai Ci Sampel Penelitian.....	46
Tabel 4.5. Kandidat Dan Non Kandidat Portofolio Optimal.....	47
Tabel 4.6. Saham Portofolio Optimal Dan Tidak Optimal	48
Tabel 4.7. Proporsi Dana Portofolio Optimal.....	49
Tabel 4.8. Return Dan Risiko Portofolio Optimal	51
Tabel 4.9. Hasil <i>Descriptive Statistic</i> Uji Normalitas.....	53
Tabel 4.10. Hasil One-Sample Kolmogorov-Smirnov Test.....	53
Tabel 4.11. Hasil Deskriptif Rata-Rata <i>Return</i> Dan Risiko Kandidat Dan Non Kandidat	55
Tabel 4.12. Hasil Uji <i>Mann Whitney (U-Test)</i> <i>Return</i> Kandidat Dan Non Kandidat	55
Tabel 4.13. Hasil Uji <i>Mann Whitney (U-Test)</i> Risiko Kandidat Dan Non Kandidat	56
Tabel 4.14. Hasil Deskriptif Rata-Rata <i>Return</i> Dan Risiko Kandidat Dan Non Kandidat	57
Tabel 4.15. Hasil Uji <i>Mann Whitney (U-Test)</i> <i>Return</i> Kandidat Dan Portofolio Optimal	57

Tabel 4.16 Hasil Uji <i>Mann Whitney (U-Test)</i> Risiko Kandidat Dan Portofolio Optimal	58
Tabel 4.17. Hasil Deskriptif Rata-Rata <i>Return</i> Dan Risiko Non Kandidat Dan Portofolio Optimal	59
Tabel 4.18. Hasil Uji <i>Mann Whitney (U-Test)</i> <i>Return</i> Non Kandidat Dan Portofolio Optimal	59
Tabel 4.19. Hasil Uji <i>Mann Whitney (U-Test)</i> Risiko Non Kandidat Dan Portofolio Optimal	50

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Model Pemikiran	21
----------------------------------	----

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. Daftar Harga Penutupan Saham Sampel Penelitian Periode 2011-2015	76
Lampiran 2. Daftar Harga Penutupan Saham IHSG dan Sertifikat Bank Indonesia Periode 2011-2015.....	79
Lampiran 3. Olah Data MS. Excel 2007, 2017	81
Lampiran 4. Olah Data SPSS 16.0, 2017.....	87