

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
HALAMAN PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	v
ABSTRAK	vi
ABSTRACT	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR TABEL	xv
DAFTAR GAMBAR	xvi
DAFTAR LAMPIRAN	xvii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	14
1.3. Tujuan dan Manfaat Penelitian	15
1.3.1. Tujuan Penelitian	15
1.3.2. Manfaat Penelitian	16
1.4. Sistematika Penulisan	17
BAB II TELAAH PUSTAKA	18
2.1. Landasan Teori	18
2.1.1. Teori Portofolio	18
2.1.2. Return dan Risiko	19
2.1.3. Reksa Dana	20
2.1.3.1. Pengertian Reksa Dana	20
2.1.3.2. Jenis-Jenis Reksa Dana	21
2.1.3.2.1. Reksa Dana Menurut Sifatnya	21
2.1.3.2.2. Reksa Dana Menurut Bentuknya	22
2.1.3.2.3. Reksa Dana Menurut Jenis	22
Instrumen Investasinya	
2.1.3.3. Biaya Investasi Reksa Dana	25
2.1.3.4. Risiko Umum dalam Berinvestasi.....	25

	Di Reksa Dana	
2.1.4.	Manajer Investasi	27
2.1.5.	Kinerja Reksa Dana	28
	2.1.5.1. <i>Treynor's Model</i>	29
	2.1.5.2. <i>Sharpe's Model</i>	29
	2.1.5.3. <i>Jensen's Model</i>	30
2.1.6.	Faktor-Faktor yang Mempengaruhi	31
	Kinerja Reksa Dana Saham	
	2.1.6.1. <i>Stock Selection Skill</i>	31
	2.1.6.2. <i>Market Timing Ability</i>	32
	2.1.6.3. <i>Expense Ratio</i>	34
	2.1.6.4. <i>Fund Size</i>	34
	2.1.6.5. <i>Turnover Ratio</i>	35
2.2.	Penelitian Terdahulu	36
2.3.	Pengaruh Variabel Bebas Terhadap Variabel	43
	Terikat dan Rumusan Hipotesis	
	2.3.1. Pengaruh <i>Stock Selection Skill</i>	43
	Terhadap Kinerja Reksa Dana Saham	
	2.3.2. Pengaruh <i>Market Timing Ability</i>	44
	Terhadap Kinerja Reksa Dana Saham	
	2.3.3. Pengaruh <i>Expense Ratio</i>	45
	Terhadap Kinerja Reksa Dana Saham	
	2.3.4. Pengaruh <i>Fund Size</i>	46
	Terhadap Kinerja Reksa Dana Saham	
	2.3.5. Pengaruh <i>Turnover Ratio</i>	47
	Terhadap Kinerja Reksa Dana Saham	
2.4.	Kerangka Pemikiran Teoritis	48
BAB III	METODE PENELITIAN	49
3.1.	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional	49
	3.1.1. Variabel Penelitian	49
	3.1.2. Definisi Operasional	50
3.2.	Populasi dan Sampel	57
3.3.	Jenis dan Sumber Data	69
	3.3.1. Jenis Data	69
	3.3.2. Sumber Data	70
3.4.	Metode Pengumpulan Data	70
3.5.	Metode Analisis Data	71
	3.5.1. Uji Asumsi Klasik	71

3.5.1.1. Uji Multikolinearitas	71
3.5.1.2. Uji Autokolerasi	72
3.5.1.3. Uji Heterokedastisitas	72
3.5.1.4. Uji Normalitas	74
3.5.2. Analisis Regresi Berganda	74
3.5.3. Uji Koefisien Determinasi	75
3.5.4. Uji Hipotesis	76
3.5.4.1. Pengujian Simultan (Uji F)	76
3.5.4.2. Pengujian Parsial (Uji Statistik T)	77
BAB IV HASIL DAN ANALISIS	78
4.1. Deskripsi Objek Penelitian	78
4.2. Analisis Data	79
4.2.1. Analisis Deskriptif Variabel Penelitian	79
4.2.2. Uji Asumsi Klasik	82
4.2.2.1. Uji Normalitas	82
4.2.2.2. Uji Autokolerasi	85
4.2.2.3. Uji Heteroskedastisitas	86
4.2.2.4. Uji Multikolerasi	88
4.2.3. Analisis Regresi Linier Berganda	88
4.2.3.1. Koefisien Determinasi (R^2)	89
4.2.3.2. Uji Signifikansi Simultan (Uji F)	89
4.2.3.3. Uji Signifikansi Parsial (Uji T)	90
4.3. Pengujian Hipotesis	92
4.4. Interpretasi Hasil	93
BAB V PENUTUP	97
5.1. Kesimpulan	97
5.2. Keterbatasan	98

5.3. Saran	98
DAFTAR PUSTAKA	100
LAMPIRAN	104