

Daftar Isi

	Halaman
Halaman Judul	i
Sertifikasi	ii
Halaman Pengesahan Tesis.....	iii
Abstract	iv
Abstrak	v
Kata Pengantar	vi
Daftar Tabel	x
Daftar Gambar	xi
Daftar Rumus	xii
Bab I Pendahuluan	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Perumusan Masalah	9
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian	
1.3.1 Tujuan Penelitian	11
1.3.2 Kegunaan Penelitian	11
Bab II Telaah Pustaka dan Pengembangan Model Penelitian	
2.1 Saham	12
2.2 Indeks Harga Saham Gabungan.....	13

2.3	Indeks LQ45	13
2.4	<i>Capital Asset Pricing Model (CAPM)</i>	
2.4.1	Pengertian CAPM	14
2.4.2	Asumsi-asumsi CAPM.....	15
2.5	Konsep <i>Return</i> dan <i>Risk</i>	16
2.6	<i>Return</i>	19
2.7	Risiko (<i>Risk</i>)	20
2.8	Portofolio	
2.8.1	Model Indeks Tunggal	22
2.8.2	Evaluasi Kinerja Portofolio	29
2.9	Penelitian Terdahulu	36
2.10	Pengembangan Kerangka Pemikiran Teoritis	40
2.11	Hipotesis	40
Bab III Metode Penelitian		
3.1	Jenis dan Sumber Data	41
3.2	Populasi dan Sampel	41
3.3	Metode Pengumpulan Data	43
3.4	Definisi Operasional Variabel	43
3.5	Teknik Analisis	44
Bab IV Hasil Pembahasan		

4.1 Deskripsi Penelitian	50
4.2 Analisis Data	
4.2.1 Risiko Saham secara Individual	52
4.2.2 Analisis Portofolio Optimal	54
4.2.3 Analisis Kinerja Portofolio	58
4.2.4 Pengujian Hipotesis	61
Bab V Kesimpulan dan Implikasi Kebijakan	
5.1 Kesimpulan	62
5.2 Implikasi Kebijakan	62
5.3 Keterbatasan Penelitian	63
5.4 Agenda Penelitian Mendatang	63
Daftar Referensi	64
Lampiran	66