

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
SERTIFIKASI.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN TESIS	iii
ABSTRAK	iv
ABSTRACT	v
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Perumusan Masalah	9
1.3 Tujuan Penelitian dan Kegunaan Penelitian	10
1.3.1 Tujuan Penelitian	10
1.3.2 Kegunaan Penelitian	11
BAB II TELAAH PUSTAKA DAN PENGEMBANGAN MODEL	
PENELITIAN	12
2.1 Telaah Pustaka	12
2.1.1 Investasi dalam Bentuk Saham	12

2.1.2	<i>Return</i> , Resiko, dan Portofolio	13
2.1.3	Diversifikasi	15
2.1.4	Portofolio Efisien dan Portofolio Optimal	18
2.1.5	<i>Capital Asset Pricing Model</i> (CAPM)	19
2.1.5.1	Asumsi-Asumsi dari <i>Capital Asset Pricing Model</i> (CAPM) ..	19
2.1.5.2	<i>Trade-off</i> Ekuilibrium antara Resiko dan Return	21
2.1.6	Pengukuran Kinerja Portofolio	23
2.2	Penelitian Terdahulu	26
2.3	Kerangka Pemikiran Teoritis	29
2.4	Hipotesis Penelitian	31
2.5	Definisi Operasional Variabel	31
BAB III METODE PENELITIAN		33
3.1	Jenis dan Sumber Data	33
3.1.1	Jenis Data	33
3.1.2	Sumber Data	34
3.2	Populasi dan Sampling	34
3.3	Metode Pengumpulan Data	35
3.4	Teknik Analisis Data	35
3.4.1	Pengukuran Kinerja Portofolio Saham dengan Metode Sharpe, Treynor dan Jensen	36
3.4.2	Perbandingan Kinerja Portofolio Saham menggunakan Uji Statistik.....	37
BAB IV ANALISIS DATA		39
4.1	Gambaran Umum Obyek Penelitian	39

4.2 Analisis Data	40
4.2.1 Analisis Kinerja Portofolio Saham dengan Metode Sharpe	40
4.2.2 Analisis Kinerja Portofolio Saham dengan Metode Treynor	42
4.2.3 Analisis Kinerja Portofolio Saham dengan Metode Jensen	44
4.2.4 Analisis Perbandingan Kinerja Portofolio Saham menggunakan Metode Sharpe, Treynor, dan Jensen	45
BAB V KESIMPULAN	53
5.1 Kesimpulan	53
5.2 Implikasi Kebijakan	54
5.3 Keterbatasan Penelitian	55
5.4 Saran	55
DAFTAR REFERENSI	
LAMPIRAN	
DAFTAR RIWAYAT HIDUP	