

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN	i
LEMBAR PERNYATAAN	ii
KATA PENGANTAR.....	iii
DAFTAR GAMBAR	vii
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR LAMPIRAN	ix
ABSTRAK	x
<i>ABSTRACT</i>	xi
 BAB I PENDAHULUAN.....	 1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Pertanyaan Penelitian.....	6
1.4 Tujuan Penelitian	6
1.5 Kontribusi Penelitian	6
1.6 Lingkup Penelitian	7
 BAB II.....	 8
2.1 Return dan Risiko Investasi Saham	8
2.1.1. Return Investasi Saham	8
2.1.2. Risiko Investasi Saham.....	10
2.1.3. Hubungan Return dan Risiko Investasi Saham	12
2.2 Analisis Fundamental.....	13
2.3 <i>Earnings Classification</i>	14
2.4 Portofolio Manajemen	16
2.4.1. Saham Optimal Model Markowitz.....	17
2.5 Kinerja Portofolio	19

2.6 Penelitian Terdahulu.....	24
2.7 Kerangka Penelitian	26
BAB III METODE PENELITIAN	29
3.1 Jenis Penelitian.....	29
3.2 Metode Pengumpulan Data.....	29
3.2.1. Jenis Data	29
3.2.2. Sumber Data.....	30
3.3 Populasi dan Sampel	31
3.4 Desain Penelitian.....	32
3.5 Pembuatan Portofolio Optimal Model Markowitz	33
3.6 Pengukuran Kinerja Portofolio	36
BAB IV ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN.....	37
4.1 Pengumpulan Data	37
4.2 Seleksi Data.....	38
4.3 Pembentukan Portofolio Model Markowitz	41
4.3.1. Portofolio ROA (NP)	41
4.3.2. Portofolio ROE (NP)	43
4.3.3. Portofolio ROA (OP)	45
4.3.4. Portofolio ROE (OP)	47
4.4 Kinerja Portofolio Optimal Berdasarkan <i>Return</i> Sesuaian Risiko .	49
4.5 Uji Beda Kinerja Perusahaan berdasarkan Rasio Profitabilitas.....	57
4.6 Pembahasan.....	59
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	65
5.1. Kesimpulan	65
5.2. Rekomendasi.....	66
5.3. Keterbatasan Penelitian.....	67
DAFTAR PUSTAKA	69
LAMPIRAN	72