

DAFTAR ISI

KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR GAMBAR	ixx
DAFTAR LAMPIRAN.....	x
INTISARI.....	xi
ABSTRACT.....	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	3
1.3 Pertanyaan Penelitian	5
1.4 Tujuan Penelitian	5
1.5 Manfaat Penelitian	6
1.6 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian	6
1.7 Sistematika Penulisan	6
BAB II LANDASAN TEORI DAN TINJAUAN PUSTAKA	7
2.1 Landasan Teori.....	7
2.1.1 Pasar Modal Indonesia	7
2.1.2 Saham.....	8
2.1.3 Sharpe Ratio	10
2.1.4 Sortino Ratio	11
2.1.5 IDX30 dan PEFINDO25	11
2.1.6 Strategi Investasi Pasif.....	15
2.1.7 Strategi Investasi Aktif.....	16
2.1.8 Pasar Modal Efisien	18
2.2 Penelitian Terdahulu dan Hipotesis	19
BAB III METODE PENELITIAN.....	23
3.1 Desain Penelitian.....	23
3.2 Definisi Operasional Variabel.....	25
3.3 Populasi dan Sampel	26

3.4 Instrumen Penelitian.....	29
3.5 Teknik Pengumpulan Data.....	29
3.6 Teknik Analisis Data.....	30
3.6.1 Statistik Deskriptif	30
3.6.2 Uji Normalitas.....	30
3.6.3 Uji Hipotesis	30
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	32
4.1 Statistik Deskriptif	32
4.1.1 PEFINDO25	32
4.1.2 IDX30.....	35
4.2 Uji Normalitas (Shapiro Wilk Signed Rank)	39
4.3 Uji Hipotesis	40
4.3.1 Uji Hipotesis <i>Return Saham Strategi Buy and Hold</i> dengan Strategi Aktif <i>Moving Average Crossover</i>	40
4.3.2 Uji Hipotesis <i>Sharpe Ratio Saham Strategi Buy and Hold</i> dengan Strategi Aktif <i>Moving Average Crossover</i>	41
4.3.3 Uji Hipotesis <i>Sortino Ratio Strategi Buy and Hold</i> dengan Strategi Aktif <i>Moving Average Crossover</i>	42
4.4 Pembahasan.....	44
BAB V KESIMPULAN.....	46
5.1 Kesimpulan	46
5.2 Implikasi.....	47
5.3 Batasan dan Saran	47
DAFTAR PUSTAKA	49
LAMPIRAN.....	52