

DAFTAR ISI

LEMBAR JUDUL	I
LEMBAR PENGESAHAN.....	II
LEMBAR PERNYATAAN	III
KATA PENGANTAR.....	IV
DAFTAR ISI	VI
DAFTAR TABEL	VIII
DAFTAR LAMPIRAN	IX
ABSTRAK	X
ABSTRACT	XI
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	5
1.3 Pertanyaan Penelitian.....	5
1.4 Ruang Lingkup Penelitian.....	6
1.5 Tujuan Penelitian	6
1.6 Manfaat Penelitian	6
1.7 Sistematika Penulisan	7
BAB II LANDASAN TEORI DAN TINJAUAN PUSTAKA.....	9
2.1 Landasan Teori.....	9
2.1.1 Teori Pasar Efisien.....	9
2.1.2 Portofolio Investasi	10
2.1.3 <i>Return</i> dan Risiko	11
2.1.4 Kriteria Graham	12
2.1.5 Kriteria Lynch	17
2.1.6 Penilaian Kinerja Portofolio.....	19
2.2 Penelitian Terdahulu.....	20
2.3 Hipotesis penelitian.....	24
BAB III METODE PENELITIAN	26
3.1 Jenis Penelitian dan Sumber Data.....	26

3.2 Metode Pengumpulan Data	27
3.3 Instrumen Penelitian	28
3.3.1 <i>Risk-Adjusted Return</i>	31
3.4 Metode Analisis Data	33
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	35
4.1 Deskripsi Data	35
4.1.1 Analisis Risiko dan <i>Return</i>	39
4.1.2 Analisis <i>Risk-Adjusted Return</i>	40
4.2 Uji Hipotesis	42
4.2.1 Uji Hipotesis Satu	43
4.2.2 Uji Hipotesis Dua	44
4.2.3 Uji Hipotesis Tiga	45
4.3 Pembahasan	46
BAB V SIMPULAN	50
5.1 Simpulan	50
5.2 Keterbatasan	51
5.3 Implikasi	51
5.4 Saran	52
DAFTAR PUSTAKA	53
LAMPIRAN	55

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1 Sampel Penelitian per Periode	35
Tabel 4.2 Daftar Emiten dalam Portofolio.....	37
Tabel 4.3 Statistik Deskriptif Risiko dan Return	39
Tabel 4.4 Statistik Deskriptif Risk-Adjusted Return.....	40
Tabel 4.5 Uji Normalitas Portofolio Graham, Lynch dan IHSG	42
Tabel 4.6 Uji Parametrik dan Non Parametrik Portofolio Graham dan IHSG.....	43
Tabel 4.7 Uji Parametrik dan Non Parametrik Portofolio Lynch dan IHSG.....	44
Tabel 4.8 Uji Parametrik dan Non Parametrik Portofolio Graham dan Lynch	45

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Uji Normalitas Portofolio Graham, Lynch dan IHSB	55
Lampiran 2 Uji Parametrik Portofolio Graham dan IHSB (Sharpe)	56
Lampiran 3 Uji Non Parametrik Portofolio Graham dan IHSB (Treyner dan Jensen)	56
Lampiran 4 Uji Parametrik Portofolio Lynch dan IHSB (Sharpe)	57
Lampiran 5 Uji Non Parametrik Portofolio Lynch dan IHSB (Treyner dan Jensen)	57
Lampiran 6 Uji Parametrik Portofolio Graham dan Lynch (Sharpe)	58
Lampiran 7 Uji Non Parametrik Portofolio Graham dan Lynch (Treyner dan Jensen)	58