

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI	v
DAFTAR TABEL	vii
ABSTRAK	viii
ABSTRACT	ix
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Pertanyaan Penelitian	4
1.4 Tujuan Penelitian	5
1.5 Manfaat Penelitian	5
1.6 Lingkup Penelitian	5
1.7 Sistematika Penulisan	6
BAB II LANDASAN TEORI	8
2.1 Nilai Saham	8
2.2 Efisiensi Pasar	8
2.3 Pasar Modal Indonesia	9
2.4 Diversifikasi	9
2.5 Data Envelopment Analysis (DEA)	10
2.5.1 Constant returns on scale (CRS)	11
2.5.2 Cross-efficiency evaluation	13
2.5.3 Relative Financial Strength (RFS)	15
2.6 Kinerja Portofolio	17
2.7 Penelitian Sebelumnya	20
2.8 Hipotesis Penelitian	21
BAB III METODA PENELITIAN	23
3.1 Data	23
3.2 Sumber Data	23
3.3 Sampling	23
3.4 Metoda Analisis Data	24
BAB IV ANALISA DAN PEMBAHASAN	27
4.1 Pemilihan Saham	27
4.2 Kinerja Portofolio	38
4.2.1 Indeks Sharpe	38
4.2.2 Indeks Treynor	40
4.2.3 Jensen's Alpha	43



UNIVERSITAS
GADJAH MADA

Analisis Kinerja Portofolio Saham Menggunakan Data Envelopment Analysis Model Cross Efficiency dengan Indeks Pasar di Indonesia

ADITYA KURNIAWAN E, Eddy Junarsin, Ph.D., C.F.P.,

Universitas Gadjah Mada, 2018 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

4.3 Pengujian Statistik	45
BAB V SIMPULAN	51
5.1 Simpulan	51
5.2 Implikasi	52
5.3 Keterbatasan	53
5.4 Saran	53
DAFTAR PUSTAKA	55
LAMPIRAN	57