

DAFTAR ISI

Lembar judul.....	i
Lembar pengesahan.....	ii
Lembar pernyataan.....	iii
Kata pengantar.....	iv
Daftar isi.....	vi
Daftar Tabel.....	ix
Daftar Gambar.....	x
Daftar Lampiran.....	xi
Intisari.....	xii
Abstract.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar belakang masalah.....	1
1.2. Pokok permasalahan.....	12
1.3. Pertanyaan dan Tujuan peneliatian	13
1.3.1 Pertanyaan Penelitian	13
1.3.2 Tujuan Penelitian	13
1.4. Metode Penelitian	13
1.5. Batasan Penelitian.....	16
1.6. Manfaat Penelitian	16
BAB II LANDASAN TEORI.....	17

2.1. Capital Asset Pricing Model	20
2.2. Resiko	24
2.3. Reksadana	27
2.3.1. Pengertian Reksadana	27
2.3.2. Reksadana berdasarkan sifatnya	27
2.3.3. Reksadana berdasarkan jenisnya	28
2.3.4. Reksadana lainnya	31
2.3.5. Reksadana indeks	31
2.3.6. Reksadana terproteksi	31
2.3.7. Reksadana dengan penjaminan	32
2.4. Resiko reksadana	32
2.4.1. Resiko menurunnya NAB unit penyertaan	33
2.4.2. Resiko likuiditas	33
2.4.2. Resiko default	33
2.5. Pengukuran Kinerja Reksadana	34
BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....	38
3.1. Sampel penelitian	38
3.2. Data dan teknik pengumpulan data	41
3.3. Teknik analisis data	42
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....	46
4.1. Pembahasan	46
4.2 Analisis kinerja reksadana dengan metode snail trail	48

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	59
5.1. Kesimpulan.....	59
5.2. Saran.....	62
Daftar Pustaka.....	63
Lampiran	64

DAFTAR TABEL

Tabel 3.1. Tabel reksadana saham yang ditawarkan oleh Citi Indonesia.....	39
Tabel 3.2. Tabel reksadana saham yang ditawarkan oleh Standard Chartered Bank Indonesia.....	40
Tabel 3.3. Tabel reksadana saham yang ditawarkan oleh HSBC Indonesia.....	41
Tabel 4.1. Tingkat pengembalian reksadana selama tahun 2013	47
Tabel 4.2. Tingkat resiko reksadana selama tahun 2011-2013.....	48
Tabel 4.3. reksadana dengan kinerja terbaik tahun 2013	48

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1. Kuadran <i>snail trail</i>	15
Gambar 2.1. Efficient frontier	19
Gambar 2.2. Resiko sistemik dan resiko non sistemik	21
Gambar 2.3. Security Market Line	23
Gambar 2.4. Profil resiko individu	25
Gambar 4.1. Snail trail – First State Sectoral Fund	49
Gambar 4.2. Snail trail – Schroder Dana Istimewa	50
Gambar 4.3. Snail trail – Schroder 90 plus	51
Gambar 4.4. Snail trail – BNP Paribas Ekuitas	52
Gambar 4.5. Snail trail – BNP Paribas Solaris	53
Gambar 4.6. Snail trail – Millenium Equity	54
Gambar 4.7. Snail trail – Grow 2 Prosper	57

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. Risk and return of First State Sectoral Fund, Schroder Dana

Istimewa, Schroder 90 plus, BNP Paribas Ekuitas, BNP

Paribas Solaris, Millenium Equity, Grow 2 Prosper 64