

DAFTAR ISI

KATA PENGANTAR	i
DAFTAR ISI	iii
DAFTAR TABEL	iv
DAFTAR GAMBAR	viii
DAFTAR LAMPIRAN	ix
INTISARI	x
ABSTRACT	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Pertanyaan Penelitian	5
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 Landasan Teori	8
2.1.1 <i>Return</i> dan Risiko	8
2.1.2 Portofolio	9
2.1.3 <i>Dividend Yield</i>	9
2.1.4 <i>Dogs of the Dow</i>	10
2.1.5 Indeks Harga Saham Gabungan	11
2.1.6 Pengukuran Performa Portofolio	11
2.2 Penelitian Terdahulu	13
2.2.1 <i>Why the Dogs of the Dow Barks Loudly In China</i>	13
2.2.2 <i>Dividend-Yield Strategies in the Canadian Stock Market</i>	14
2.2.3 <i>The Dogs of the Dow Myth</i>	14
2.3 Perumusan Hipotesis	15
BAB III METODA PENELITIAN	17
3.1 Desain Penelitian	17
3.2 Metoda Pengumpulan Data dan Sumber Data	17
3.3 Definisi Operasional.....	18
3.4 Metoda Analisis Data	20
BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN	21
4.1 Portofolio <i>Dogs of The Dow</i> dan Kondisi Pasar Saham.....	21
4.2 Uji <i>Dogs of The Dow (Rebalancing</i> Setiap Tahunnya).....	23
4.3 Uji <i>Dogs of The Dow</i> (Tahunan)	30
4.3.1 Periode Penelitian 2008	30
4.3.2 Periode Penelitian 2009	35
4.3.3 Periode Penelitian 2010	40
4.3.4 Periode Penelitian 2011	46
4.3.5 Periode Penelitian 2012	51
4.3.6 Periode Penelitian 2013	57

4.3.7 Periode Penelitian 2014	61
4.3.8 Periode Penelitian 2015	67
4.3.9 Periode Penelitian 2016	70
4.4 Uji Post Hoc	71
4.4.1 Portofolio <i>Dogs of The Dow</i> Isi 15 Saham	71
4.4.2 Portofolio <i>Dogs of The Dow</i> Isi 10 Saham	72
4.4.3 Portofolio <i>Dogs of The Dow</i> Isi 5 Saham	72
4.5 Pengujian Kinerja Portofolio dengan Metode <i>Sharpe Ratio</i>	73
4.5.1 Perbandingan Uji Sharpe <i>Dogs of The Dow</i> Isi 15 Saham dan IHSG	73
4.5.2 Perbandingan Uji Sharpe <i>Dogs of The Dow</i> Isi 10 Saham dan IHSG	74
4.5.3 Perbandingan Uji Sharpe <i>Dogs of The Dow</i> Isi 5 Saham dan IHSG	74
4.5.4 Uji Sharpe <i>Ratio</i> Portofolio <i>Dogs of The Dow Tahunan</i> Isi 15 Saham dan IHSG	75
4.5.5 Uji Sharpe <i>Ratio</i> Portofolio <i>Dogs of The Dow Tahunan</i> Isi 10 Saham dan IHSG	76
4.5.6 Uji Sharpe <i>Ratio</i> Portofolio <i>Dogs of The Dow Tahunan</i> Isi 15 Saham dan IHSG	78
4.6 Pembahasan	79
BAB V SIMPULAN	82
5.1 Simpulan.....	82
5.2 Implikasi.....	83
5.3 Keterbatasan Penelitian	83
5.4 Saran.....	83
DAFTAR PUSTAKA.....	85
LAMPIRAN	88