



DAFTAR ISI

Halaman Judul	i
Halaman Pengesahan	ii
Halaman Pernyataan	iii
Kata Pengantar	iv
Daftar Isi	v
Daftar Tabel	vii
Daftar Gambar	viii
Daftar Lampiran.....	ix
Intisari	x
Abstract	xi
 Bab I Pendahuluan	
I.1 Latar Belakang	1
I.2 Perumusan Masalah	4
I.3 Batasan Masalah	4
I.4 Tujuan Penelitian	5
I.5 Manfaat Penelitian	5
 Bab II Teori & Perumusan Hipotesis	
II.1 Teori.....	6
II.2 Perumusan Hipotesis	14
 Bab III Metoda Penelitian	



III.1 Data Penelitian.....	16
----------------------------	----

III.2 Pengujian Hipotesis.....	17
--------------------------------	----

Bab IV Analisis Data dan Pembahasan

IV.1 Deskripsi Data.....	20
--------------------------	----

IV.2 Analisis Risiko Sektor Berdasarkan Beta Historis.....	21
--	----

IV.3 Analisis Selisih <i>Return</i>	33
---	----

IV.4 Analisis Sektor Dengan <i>Treynor Performance Measure</i>	35
--	----

Bab V Kesimpulan dan Saran.....	37
---------------------------------	----

Daftar Pustaka	39
----------------------	----



DAFTAR TABEL

TABEL 4.1	Deskripsi data return harian saham tahun 2004-2007	20
TABEL 4.2	Ringkasan uji nilai beta, koefisien korelasi, nilai F, F hitung, Nilai T, T hitung, beta dan standard deviasi tahun 2004-2007	22
TABEL 4.2.1	Koefisien korelasi R, nilai F, p-value F, Nilai t, p-value t, beta tahun 2004-2007, sektor pertanian	23
TABEL 4.2.2	Koefisien korelasi R, nilai F, p-value F, Nilai t, p-value t, beta tahun 2004-2007, sektor industri dasar	24
TABEL 4.2.3	Koefisien korelasi R, nilai F, p-value F, Nilai t, p-value t, beta tahun 2004-2007, sektor properti.	25
TABEL 4.2.4	Koefisien korelasi R, nilai F, p-value F, Nilai t, p-value t, beta tahun 2004-2007, sektor barang konsumsi	26
TABEL 4.2.5	Koefisien korelasi R, nilai F, p-value F, Nilai t, p-value t, beta tahun 2004-2007, sektor keuangan	27
TABEL 4.2.6	Koefisien korelasi R, nilai F, p-value F, Nilai t, p-value t, beta tahun 2004-2007, sektor infrastruktur	28
TABEL 4.2.7	Koefisien korelasi R, nilai F, p-value F, Nilai t, p-value t, beta tahun 2004-2007, sektor pertambangan	29
TABEL 4.2.8	Koefisien korelasi R, nilai F, p-value F, Nilai t, p-value t, beta tahun 2004-2007, sektor aneka industri	30
TABEL 4.2.8	Koefisien korelasi R, nilai F, p-value F, Nilai t, p-value t, beta tahun 2004-2007, sektor perdagangan	31



DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.	Distribusi Probabilitas	7
Gambar 2.	Hubungan Portofolio dan Standard Deviasi	8
Gambar 3.	CAPM dan Market Risk	13



DAFTAR LAMPIRAN

LAMPIRAN 1 : DATA INDEKS IHSG & SEKTOR 2004 – 2007

LAMPIRAN 2 : PENGUJIAN BETA SEKTORAL

Pengujian beta sektor agriculture	1
Pengujian beta sektor basic industri	3
Pengujian beta sektor properti	4
Pengujian beta sektor consumer goods	5
Pengujian beta sektor financial	7
Pengujian beta sektor infrastruktur	9
Pengujian beta sektor mining	10
Pengujian beta sektor miscellaneous industri.....	12
Pengujian beta sektor trading.....	13

LAMPIRAN 3 : PENGUJIAN SELISIH *RETURN*

Pengujian selisih <i>return</i> sektor agriculture.....	1
Pengujian selisih <i>return</i> sektor basic industri	2
Pengujian selisih <i>return</i> sektor properti	3
Pengujian selisih <i>return</i> sektor consumer goods	4
Pengujian selisih <i>return</i> sektor financial	5
Pengujian selisih <i>return</i> sektor infrastruktur	5
Pengujian selisih <i>return</i> sektor mining	6
Pengujian selisih <i>return</i> sektor miscellaneous industri.	7
Pengujian selisih <i>return</i> sektor trading	8