

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
PRAKATA	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN	xi
INTISARI.....	xii
ABSTRACT	xiii
I. PENGANTAR.....	I
A. Latar Belakang	1
B. Perumusan Masalah.....	6
C. Tujuan Penelitian.....	7
D. Manfaat Penelitian.....	8
II. TINJAUAN PUSTAKA	10
A. Tinjauan Pustaka	10
A.1. Konsep Dasar Investasi	10
A.2. Konsep Return dan Risiko Investasi	12

A.3. Konsep Portofolio Model Markowitz.....	14
A.4. <i>Capital Market Line</i> dan <i>Security Market Line</i>	20
1. <i>Capital Market Line</i>	20
2. <i>Security Market Line</i>	24
A.5. Konsep Model Indeks Tunggal	27
A.6. <i>Capital Aset Pricing Model</i> (CAPM).....	31
A.7. Diversifikasi Internasional dan Integrasi Pasar Modal.....	34
A.8. Pengukuran Kinerja Portofolio.....	38
B. Penelitian Sebelumnya	42
III. METODA PENELITIAN	46
A. Data Penelitian	46
B. Sampel Penelitian.....	46
C. Asumsi Penelitian.....	47
D. Definisi Operasional.....	47
E. Model Analisis Data.....	49
E.1. Tingkat Integrasi Pasar Modal.....	49
E.2. Korelasi Antar Pasar Modal.....	50
E.3. Risiko Total Investor Asing.....	51
E.4. Kinerja Portofolio Internasional	53
IV. HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	57
A. Tingkat Integrasi Pasar Modal di Wilayah Asia Pasifik	57
B. Korelasi Antar Pasar Modal di Wilayah Asia Pasifik.....	64

C. Risiko Total Investor Asing	66
D. Kinerja Portofolio Internasional	69
V. KESIMPULAN	73
A. Kesimpulan.....	73
B. Keterbatasan Penelitian	74
C. Saran.....	75
C.1. Untuk Penelitian Selanjutnya	75
C.2. Implikasi Kebijakan.....	75
DAFTAR PUSTAKA	77
LAMPIRAN	79