

DAFTAR ISI

Lembar judul.....	i
Lembar pengesahan.....	ii
Lembar pernyataan.....	iii
Kata pengantar.....	iv
Daftar isi.....	vi
Daftar Tabel.....	viii
Daftar Gambar.....	ix
Daftar Lampiran.....	x
Abstrak.....	xi
Abstract.....	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang.....	1
1.2. Rumusan Masalah.....	6
1.3. Pertanyaan Penelitian.....	7
1.4. Tujuan Penelitian	7
1.5. Manfaat Penelitian	9
1.6. Lingkup Penelitian.....	9
1.7. Sistematika Pembahasan	11
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	12
2.1. Portofolio Saham	12
2.2. <i>Value</i> dan <i>Glamour Stock</i>	14
2.3. Portofolio <i>Value</i> dan <i>Glamour Stock</i>	15
2.4. Pengukuran Kinerja Portofolio dengan Penyesuaian Risiko....	16
2.5. Penelitian Terdahulu dan Pengembangan Hipotesis.....	21
BAB III METODELOGI PENELITIAN	23
3.1. Desain Penelitian	23

3.2. Metode Pengumpulan Data	23
3.2.1. Data.....	23
3.2.2. Teknik Pengambilan Sampel	24
3.3. Definisi Operasional	24
3.4. Teknik Analisis Data.....	27
3.4.1. Pengukuran Kinerja Portofolio Saham dengan Metode Sharpe, Treynor dan Jensen.....	27
3.4.2. Metode Statistik	29
BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN	30
4.1. Data Penelitian.....	30
4.2. Statistik Deskriptif	31
4.3. Hasil Pengujian Hipotesis	36
4.3.1. Hasil Uji Beda <i>Return</i> Portofolio.....	36
4.3.2. Hasil Uji Beda Risiko Portofolio	38
4.4. Pembahasan hasil.....	40
4.4.1. Perbedaan <i>Return</i> Portofolio <i>Value Stock</i> dan <i>Glamour Stock</i> Pada Periode Krisis.....	40
4.4.2. Perbedaan <i>Return</i> Portofolio <i>Value Stock</i> dan <i>Glamour Stock</i> Pada Periode Non Krisis	41
4.4.3. Perbedaan Risiko Portofolio <i>Value Stock</i> dan <i>Glamour Stock</i> Pada Periode Krisis.....	43
4.4.4. Perbedaan Risiko Portofolio <i>Value Stock</i> dan <i>Glamour Stock</i> Pada Periode Non Krisis	43
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	45
5.1. Kesimpulan.....	45
5.2. Keterbatasan	46
5.3. Saran.....	47
Daftar Pustaka	48

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1	Proses Pemilihan Sampel.....	30
Tabel 4.2	Statistik Deskriptif: Data PBV dan PER Pada Periode Krisis dan Non Krisis.....	32
Tabel 4.3	Statistik Deskriptif: <i>Value Stock</i> dan <i>Glamour Stock</i> Berdasarkan Indikator PBV dan PER Pada Periode Krisis dan Non Krisis	33
Tabel 4.4	Statistik Deskriptif: Rata-rata <i>Return</i> dan Risiko Portofolio <i>Value Stock</i> dan <i>Glamour Stock</i> Pada Periode Krisis dan Non Krisis.....	34
Tabel 4.5	Uji Beda <i>Return</i> Portofolio <i>Value Stock</i> dan <i>Glamour Stock</i> Pada Periode Krisis dan Non Krisis	36
Tabel 4.6	Uji Beda Risiko Portofolio <i>Value Stock</i> dan <i>Glamour Stock</i> Pada Periode Krisis dan Non Krisis.....	38

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1. Perjalanan Pasar Modal dan IHSG	2
---------------------------------------------------	---

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Data Penelitian.....	50
Lampiran 2 Hasil Uji Beda rerata T-Test Periode Krisis.....	70
Lampiran 3 Hasil Uji Beda rerata T-Test Periode Non Krisis	79