

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN	ii
PERNYATAAN KEASLIAN TUGAS AKHIR	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI.....	v
DAFTAR TABEL	vii
DAFTAR GAMBAR	viii
DAFTAR LAMPIRAN	ix
INTISARI.....	xi
<i>ABSTRACT</i>	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Batasan masalah	3
1.3 Rumusan Masalah	3
1.4 Tujuan Penelitian.....	4
1.5 Manfaat Penelitian.....	4
1.6 Kerangka Penelitian.....	5
BAB II GAMBARAN UMUM	7
2.1 Landasan Teori	7
2.1.1 Investasi.....	7
2.1.2 Saham.....	8
2.1.3 Model Keseimbangan	10
2.1.4 Teori Portofolio Markowitz.....	10
2.1.5 Portofolio Efisien.....	13
2.1.6 <i>Capital Asset Pricing Model (CAPM)</i>	14
2.1.7 <i>Arbitrage Pricing Theory (APT)</i>	18
2.1.8 Indikator Makroekonomi.....	20
2.2 Penelitian Terdahulu	24
2.3 Metodologi Penelitian.....	25
2.4.1 Jenis Penelitian	25

2.4.2	Objek dan Subjek Penelitian	25
2.4.3	Jenis dan Sumber Data	27
2.4.4	Metode Pengumpulan Data	27
2.4.5	Teknik Pengambilan Sampel	27
2.4.6	Variabel Penelitian	28
2.4.7	Tahapan Analisis Data	30
BAB III ANALISIS DAN PEMBAHASAN		34
3.1	Statistik Deskriptif	34
3.2	<i>Return</i> Saham LQ45	34
3.3	Analisis Regresi	36
3.4.1	Analisis Regresi Model CAPM	36
3.4.2	Analisis Regresi Data Panel Model APT	39
BAB IV KESIMPULAN DAN SARAN		41
4.1	Kesimpulan	41
4.2	Saran	42
DAFTAR PUSTAKA		43
LAMPIRAN		46