

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	
HALAMAN PENGESAHAN.....	i
HALAMAN PERNYATAAN	ii
KATA PENGANTAR	iii
DAFTAR ISI.....	v
DAFTAR TABEL.....	vi
DAFTAR GAMBAR	viii
DAFTAR LAMPIRAN.....	ix
ABSTRAK.....	x
ABSTRACT.....	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang Masalah.....	1
1.2. Rumusan Masalah	9
1.3. Tujuan Penelitian	9
1.4. Manfaat Penelitian	9
1.5. Batasan Penelitian	10
1.6. Sistematika Penulisan	11
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA	12
2.1. Investasi	12
2.1.1 Definisi Investasi.....	12
2.1.2 Jenis Investasi	13
2.1.3 Tahapan Investasi.....	13
2.1.4 Kinerja Investasi	14
2.2. Return dan Risiko Investasi	15
2.2.1 Return (Imbal Hasil)	15
2.2.2 Risiko	16
2.2.3 Korelasi antara Return dan Risiko	17
2.3. Teori Portofolio Modern	19
2.3.1 Definisi Portofolio.....	19
2.3.2 Portolio Optimal Metode Sharpe	21
2.3.3 Pengukuran Kinerja Portofolio	23
2.4. Reksa Dana	26

2.4.1	Definisi Reksa Dana.....	26
2.4.2	Jenis – jenis Reksa Dana.....	29
2.4.3	Risiko Reksa Dana.....	35
2.4.4	Manfaat Investasi Reksa Dana.....	36
2.5.	<i>Rebalancing</i>	37
BAB 3 METODA PENELITIAN.....		40
3.1.	Populasi dan Sampel Penelitian.....	40
3.2.	Pengumpulan Data Penelitian.....	44
3.3.	Jenis Data.....	44
3.4.	Definisi Variabel Penelitian.....	45
3.5.	Teknik Analisis Data.....	46
3.5.1	Pembentukan Portofolio Optimal dengan Metode Sharpe.....	47
3.5.2	Mengukur Kinerja Portofolio.....	50
3.5.3	Proses Rebalancing Portofolio Secara Berkala.....	51
BAB 4 ANALISIS DATA.....		52
4.1.	Analisis Portofolio Optimal Saham LQ45 yang Dibentuk dengan Metode Sharpe dan Proses <i>Rebalancing</i>	52
4.2.	Perbandingan Kinerja Reksa Dana Saham dan Portofolio Optimal dengan Metode RDIV.....	56
4.3.	Diskusi.....	58
BAB 5 KESIMPULAN DAN SARAN.....		62
5.1.	Kesimpulan.....	62
5.2.	Keterbatasan.....	63
5.3.	Saran.....	63
DAFTAR PUSTAKA.....		65