

DAFTAR ISI

LEMBAR JUDUL	i
LEMBAR PERNYATAAN	ii
KATA PENGANTAR	iii
DAFTAR ISI	v
DAFTAR TABEL	vii
DAFTAR GAMBAR	viii
DAFTAR LAMPIRAN	ix
INTISARI.....	x
<i>ABSTRACT</i>	xi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Tujuan Penelitian	5
1.4 Manfaat Penelitian	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	7
2.1 Landasan Teori.....	7
2.1.1 Teori portofolio investasi	7
2.1.2 Risk and Return.....	8
2.1.3 Single Index Model	10
2.1.4 Pengukuran Kinerja Portofolio	11
2.2 Kajian Penelitian Terdahulu dan Pengembangan Hipotesis	14
2.3 Kerangka Pemikiran.....	16
BAB III METODE PENELITIAN.....	19
3.1 Rancangan dan Ruang Lingkup Penelitian	19
3.2 Metode Pengumpulan Data	20
3.3 Definisi Operasional dan Instrumen Penelitian.....	21
3.3.1 Membentuk Portofolio Optimal dengan <i>Single Index Model</i>	22
3.3.2 Kinerja Portofolio Saham.....	24

3.4 Metoda Analisis Data	25
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	26
4.1 Pembentukan Saham Kandidat Portofolio	26
4.2 Analisis Tingkat Pengembalian dan Risiko Portofolio	28
4.3 Menentukan Portofolio Optimal dan Proporsi Dana.....	30
4.4 Uji Hipotesis.....	32
4.4.1 Perbandingan Kinerja Portofolio dengan Metode Sharpe.....	32
4.4.2 Perbandingan Kinerja Portofolio dengan Metode Treynor.....	34
4.4.3 Perbandingan Kinerja Portofolio dengan Metode Jensen	35
4.5 Pembahasan.....	37
BAB V PENUTUP.....	38
5.1 Kesimpulan	38
5.2 Keterbatasan.....	38
5.3 Saran.....	38
DAFTAR PUSTAKA	39

DAFTAR TABEL

Tabel 3.1	Daftar Saham LQ45 dan JII Tahun 2016 Sampai Tahun 2019.....	21
Tabel 3.2	Perhitungan Portofolio Optimal dengan <i>Single Index Model</i>	23
Tabel 4.1	Saham Indeks LQ45 Sebagai Kandidat Portofolio	26
Tabel 4.2	Saham Indeks JII Sebagai Kandidat Portofolio	27
Tabel 4.3	Perhitungan Return Portofolio Saham LQ45	28
Tabel 4.4	Perhitungan Return Portofolio Saham JII	29
Tabel 4.5	Perhitungan Skala Tertimbang (Z_i) dan Proporsi Dana (W_i) Portofolio LQ45	31
Tabel 4.6	Perhitungan Skala Tertimbang (Z_i) dan Proporsi Dana (W_i) Portofolio JII	31
Tabel 4.7	Hasil Perbandingan Kinerja Portofolio dengan Metode Sharpe	32
Tabel 4.8	Perhitungan Kinerja Portofolio Saham LQ45 dan JII dengan Metode Sharpe	33
Tabel 4.9	Hasil Perbandingan Kinerja Portofolio dengan Metode Treynor	34
Tabel 4.10	Perhitungan Kinerja Portofolio Saham LQ45 dan JII dengan Metode Treynor	35
Tabel 4.11	Hasil Perbandingan Kinerja Portofolio dengan Metode Jensen	35
Tabel 4.12	Perhitungan Kinerja Portofolio Saham LQ45 dan JII dengan Metode Jensen	36

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Risiko Portofolio Melalui Penambahan Jumlah Saham.....	9
Gambar 2.2 Kerangka Pemikiran Teoritis	18
Gambar 4.1 Perbandingan Return Portofolio LQ45 dan JII	30

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1	Return Saham Portofolio LQ45 Periode 2016 sampai 2019	41
Lampiran 2.	Return Saham Portofolio JII Periode 2016 sampai 2019	43
Lampiran 3.	Portofolio Saham LQ45 Tahun 2016	45
Lampiran 4.	Portofolio Saham LQ45 Tahun 2017	45
Lampiran 5.	Portofolio Saham LQ45 Tahun 2018	46
Lampiran 6.	Portofolio Saham LQ45 Tahun 2019	46
Lampiran 7.	Portofolio Saham JII Tahun 2016.....	47
Lampiran 8.	Portofolio Saham JII Tahun 2017.....	47
Lampiran 9.	Portofolio Sah am JII Tahun 2018.....	48
Lampiran 10.	Portofolio Saham JII Tahun 2019.....	48