

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN	ii
PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR GAMBAR	ix
DAFTAR LAMPIRAN.....	x
INTISARI	xi
<i>ABSTRACT</i>	xii
BAB I PENDAHULUAN.....	13
1.1 Latar Belakang Masalah	13
1.2 Rumusan Permasalahan Studi Kasus.....	16
1.3 Pertanyaan Penelitian.....	17
1.4 Tujuan Penelitian	17
1.5 Manfaat Penelitian	17
1.6 Ruang Lingkup Dan Batasan Penelitian	18
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	19
2.1 Investasi	19
2.2 Dasar Keputusan Investasi.....	20
2.3.1 <i>Return</i> Ekspektasian.....	20
2.3.2 Risiko	21
2.3.3 Hubungan antara <i>Return</i> dan Risiko	23
2.3 Portofolio	23
2.3.1 Pengertian Portofolio	23
2.3.2 Diversifikasi.....	24
2.3.3 Portofolio Optimal	25
BAB III METODE PENELITIAN	29
3.1 Konteks Riset.....	29
3.2 Obyek Penelitian.....	29
3.2.1 Indeks LQ-45	29
3.2.2 Portofolio Dari Reksadana Saham	30



3.3	Metode Pengolahan Data	32
3.3.1	Pembentukan Portofolio Optimal Metoda Sharpe Ratio	32
BAB IV HASIL PENELITIAN STUDI KASUS		33
4.1	Deskripsi Data	33
4.1.1	Pengumpulan Data.....	33
4.1.2	Jenis Data.....	33
4.1.3	Teknik Pengumpulan Data.....	33
4.2	Pembentukan Portofolio Optimal	34
4.3	Pembahasan	37
BAB V SIMPULAN DAN SARAN.....		42
5.1	Simpulan	42
5.2	Keterbatasan Penelitian	42
5.3	Saran	43
DAFTAR PUSTAKA		44



DAFTAR TABEL

Tabel 1. Return Absolut Hasil Investasi Bursa Dunia	15
Tabel 2. Reksadana Saham yang Dimiliki DPLK BRI Saham	15
Tabel 3. Perbandingan Data Historis Portfolio Saat Ini Dengan Index LQ45	38
Tabel 4. Portofolio Optimal	39



DAFTAR GAMBAR

Gambar 1. Aset Kelolaan DPLK BRI Per 30 April 2017	13
Gambar 2. Systematic and Nonsystematic Risk	24
Gambar 3. Portofolio Optimal Berdasarkan Preferensi Investor	26
Gambar 4. Portofolio Optimal dengan Aktiva Bebas Risiko	27
Gambar 5. Tahap-tahap Penelitian.....	32



DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. Nilai Aktiva Bersih Realisasian DPLK BRI Saham.....	46
Lampiran 2. Nilai Index LQ45 (periode Februari 2017 - Juli 2017)	50
Lampiran 3. Perhitungan Portfolio Optimal Berbasis Reksadana Periode Februari 2017-Juli 2017	54
Lampiran 4. Perhitungan Portfolio Optimal Berbasis Reksadana Periode Februari 2017-April 2017	57
Lampiran 5. Perhitungan Portfolio Optimal Berbasis Reksadana Periode Maret 2017-Mei 2017	60
Lampiran 6. Perhitungan Portfolio Optimal Berbasis Reksadana Periode April 2017-Juni 2017	63
Lampiran 7. Perhitungan Portfolio Optimal Berbasis Reksadana Periode Mei 2017 - Juli 2017	66
Lampiran 8. Perhitungan Portfolio Optimal Berbasis Saham LQ45 Periode Februari 2017 - Juli 2017	68
Lampiran 9. Perhitungan Portfolio Optimal Berbasis Saham LQ45 Periode Februari 2017 - April 2017.....	72
Lampiran 10. Perhitungan Portfolio Optimal Berbasis Saham LQ45 Periode Maret 2017 - Mei 2017	76
Lampiran 11. Perhitungan Portfolio Optimal Berbasis Saham LQ45 Periode April 2017 - Juni 2017	80
Lampiran 12. Perhitungan Portfolio Optimal Berbasis Saham LQ45 Periode Mei 2017 - Juli 2017	84