

DAFTAR ISI

Halaman Sampul Depan	i
Halaman Judul	ii
Lembar Persetujuan	iii
Lembar Pengesahan	iv
Penyataan Keaslian	v
Surat Pernyataan Publikasi.....	vi
Motto	vii
Persembahan	viii
Kata Pengantar	ix
Daftar Isi.....	xi
Daftar Tabel	xiv
Daftar Gambar.....	xv
Daftar Lampiran.....	xvi
Abstrak	xvii
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Identifikasi Masalah dan Batasan Penelitian	9
C. Rumusan Masalah.....	10
D. Tujuan Penelitian.....	11
E. Kegunaan Penelitian	11
F. Ruang Lingkup.....	13
G. Penegasan Variable	14
H. Sistematika Penulisan.....	18

BAB II LANDASAN TEORI	20
A. Investasi	20
B. Pasar Modal	23
C. Saham	25
D. Return	30
E. Expected Return.....	32
F. Resiko.....	34
G. Hubungan antara return dan resiko.....	35
H. Portofolio	36
I. Model Indeks Tunggal	38
J. Penelitian Terdahulu	40
K. Kerangka Konseptual	43
L. Hipotesis Penelitian	44
BAB III METODE PENELITIAN	46
A. Pendekatan Penelitian dan Jenis Penelitian	46
B. Populasi, Sampling dan Sampel Penelitian	47
C. Sumber Data, Variabel dan Skala Pengukuran.....	51
D. Teknik Pengumpulan Data	54
BAB IV HASIL PENELITIAN.....	64
A. Gambaran Umum Objek Penelitian.....	64
B. Deskripsi Data	80
C. Analisis dan Interpretasi Data.....	82
D. Analisis Return Pasar, Expected Return Pasar, Variance Pasar dan Standar Devisiasi Pasar.....	88
E. Analisis Kovarian Saham Individu dengan Return Pasar	90
F. Analisis Perhitungan Beta, Alpha, dan Kesalahan Residu (Variance Error	

Residual).....	93
G. Analisis perhitungan Return Bebas Resiko dan Memilih Nilai Expected Return Lebih Besar Dari Return Bebas Resiko	96
H. Analisis Cut-Off Rate	100
I. Analisis Menentukan <i>Cut-off poin</i>	102
J. Analisis Perhitungan Dana.....	104
K. Analisis Perhitungan Expected Return Portofolio.....	106
L. Analisis Risiko Portofolio.....	108
BAB V PEMBAHASAN	110
A. Penyusunan Portofolio Optimal dengan Model Indeks Tunggal pada Bursa Efek Indonesia (BEI).....	110
B. Saham yang tergabung dalam portofolio optimal pada IDX Value30 yang tercatat pada Bursa Efek Indonesia.....	113
C. Proposi dana pada masing-masing saham yang tergabung dalam IDX Value30 di Bursa Efek Indonesia	115
D. Pengaruh Debt to Equity Ratio Terhadap Return Saham	110
E. Pengaruh ROA, ROE, CR dan DER Terhadap Return Saham.....	113
BAB VI PENUTUP	120
A. Kesimpulan.....	120
B. Saran	121
DAFTAR PUSTAKA	123
Lampiran	133