

DAFTAR ISI

	Halaman
KATA PENGANTAR	ii
ABSTRAK.....	iv
ABSTRACT	v
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
I. PENDAHULUAN	
A. LATAR BELAKANG	1
B. IDENTIFIKASI MASALAH	8
C. BATASAN MASALAH	9
D. RUMUSAN MASALAH	9
E. TUJUAN PENELITIAN	10
F. MANFAAT PENELITIAN	10
II. TINJAUAN PUSTAKA	
A. KAJIAN TEORI	11
1. Pengertian Investasi	11
2. Jenis-jenis Investasi.....	13
3. Saham	
a. Definisi Saham	14
b. Nilai Saham	16
4. Portofolio	18
5. Model Indeks Tunggal	21
- Tingkat Pengembalian	24
- Risiko Investasi	26
- Return Pasar	29
- Covarian antara dua variabel	30

	- Beta Pasar	32
	- Perhitungan Excess Return to Beta	34
	6. Capital Asset Pricing Model (CAPM)	38
	7. Teori Analisis Hubungan	42
	B. HASIL PENELITIAN YANG RELEVAN	45
III	METODELOGI PENELITIAN	
	A. KERANGKA PEMIKIRAN	51
	B. HIPOTESIS	55
	C. METODE PENELITIAN.....	55
	D. DATA, TEMPAT, DAN WAKTU PENELITIAN	57
	E. TEKNIK PENGUMPULAN DATA	57
	F. TEKNIK PENGAMBILAN SAMPEL	58
	G. DEFINISI OPERASIONAL PENELITIAN	58
	H. PENGUJIAN HIPOTESIS	61
IV	HASIL DAN PEMBAHASAN	
	A. GAMBARAN UMUM OBJEK PENELITIAN	
	1. Pengertian dan Perkembangan Pasar Modal Di Indonesia	76
	2. Organisasi Pasar Modal Indonesia	78
	3. Instrumen yang diperdagangkan di BEJ	83
	4. Sistem Perdagangan dan Penyelesaian Transaksi Di Bursa Efek Jakarta	85
	5. Proses " Go Public" di Bursa Efek Jakarta	88
	6. Informasi singkat 27 Emiten	89
	B. HASIL ANALISIS	102
	1. Pemilihan Saham untuk Portofolio Optimal	102
	- Perhitungan Portofolio Optimal	103
	- Perhitungan Excess Return to Beta (ERB)	110
	- Penentuan Saham masuk Portofolio Optimal	116
	- Saham saham yang terpilih	120

- Perhitungan Porsi Dana Investasi per-Saham	121
- Perhitungan Return dan Resiko Portofolio	124
2. Uji Keeratan Hubungan	128
C. PENGUJIAN HIPOTESIS	130
V. KESIMPULAN DAN SARAN	
- KESIMPULAN.....	133
- SARAN-SARAN	135
DAFTAR PUSTAKA	137
LAMPIRAN-LAMPIRAN	140