

DAFTAR ISI

LEMBAR JUDUL	i
LEMBAR PERSETUJUAN	ii
LEMBAR PENGESAHAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRAK	vi
ABSTRACT	vii
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii

BAB I PENDAHULUAN

A. Latar Belakang Masalah	1
B. Identifikasi Masalah	6
C. Pembatasan Masalah	6
D. Rumusan Masalah	7
E. Tujuan dan Manfaat Penelitian	7
F. Sistematika Penulisan	8

BAB II LANDASAN TEORI

A. Kajian Teori	10
1. Investasi	10

2. Saham	11
3. Indeks LQ45	13
4. <i>Risk and Return</i>	
5. Portofolio	15
6. Teori Perhitungan Portofolio Model Markowitz	15
7. Teori Perhitungan <i>Sinle Index Model</i>	18
B. Penelitian Sebelumnya	22
C. Kerangka Berpikir	26
D. Hipotesis	28
 BAB III	 METODOLOGI PENELITIAN
A. Waktu dan Tempat Penelitian	29
B. Sumber Data	29
C. Populasi dan Sampel	30
D. Metode Pengumpulan Data	33
E. Metode Analisa Data	33
 BAB IV	 GAMBARAN UMUM OBYEK PENELITIAN
A. Bursa Efek Indonesia	40
B. Emiten dalam Obyek Penelitian	51
1. PT Astra Agro Lestari Tbk. (AALI)	52
2. PT Bank Central Asia Tbk. (BBCA)	54

3. PT Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk. (BBNI)	55
4. PT Bank Rakyat Indonesia (Persero) Tbk. (BBRI)	56
5. PT Bank Danamon Indonesia Tbk. (BDMN)	57
6. PT Bank Mandiri (Persero) Tbk. (BMRI)	58
7. PT Vale Indonesia Tbk (INCO)	60
8. PT Indofood Sukses Makmur Tbk. (INDF)	61
9. PT Indo Tambangraya Megah Tbk. (ITMG)	62
10. PT Lippo Karawaci Tbk. (LPKR)	63
11. PT PP London Sumatra Indonesia Tbk. (LSIP)	64
12. PT Perusahaan Gas Negara (Persero) Tbk. (PGAS)	66
13. PT Tambang Batubara Bukit Asam (Persero) Tbk (PTBA)	67
14. PT Semen Indonesia (Persero) Tbk. (SMGR)	68
15. PT United Tractors Tbk. (UNTR)	69

BAB V

HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

A. Proses Analisis	71
1. Mendeskripsikan Pergerakan IHSG dan LQ45	71
2. Membentuk Portofolio Menggunakan Model <i>Markowitz</i>	74
3. Membentuk Portofolio Menggunakan <i>Single Index Model</i>	80
B. Pengujian Hipotesis	90

BAB VI KESIMPULAN DAN SARAN

A. Kesimpulan	92
B. Saran	93

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN-LAMPIRAN