

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL .....</b>	<b>i</b>
<b>HALAMAN PENGESAHAN.....</b>	<b>ii</b>
<b>HALAMAN PERNYATAAN.....</b>	<b>iii</b>
<b>KATA PENGANTAR.....</b>	<b>iv</b>
<b>ABSTRAK .....</b>	<b>iv</b>
<b>ABSTRACT .....</b>	<b>vii</b>
<b>DAFTAR ISI.....</b>	<b>ix</b>
<b>DAFTAR TABEL .....</b>	<b>xi</b>
<b>DAFTAR GAMBAR.....</b>	<b>xii</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
1.1    Gambaran Umum Objek Penelitian .....	1
1.2    Latar Belakang Penelitian .....	2
1.3    Perumusan Masalah .....	13
1.4    Tujuan Penelitian .....	13
1.5    Manfaat Penelitian .....	14
1.6    Sistematika Penulisan Tugas Akhir .....	14
<b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....</b>	<b>16</b>
2.1    Teori dan Penelitian Terdahulu.....	16
2.1.1    Teori Pasar Modal.....	16
2.1.2    Teori Investasi.....	16
2.1.3    Pengertian Saham.....	17
2.1.4    Risiko dan <i>Return</i> .....	17
2.1.5    Teori dan Pembentukan Portofolio .....	18
2.1.6    Model Indeks Tunggal .....	20
2.1.7    Model Indeks Tunggal dalam Pembentukan Portofolio Optimal .....	21

2.1.8 Teori <i>Capital Asset Pricing Model</i> (CAPM) .....	23
2.1.9 <i>Capital Asset Pricing Model</i> (CAPM) dalam Pembentukan Portofolio Optimal.....	24
2.1.10 Evaluasi Kinerja Portofolio Optimal.....	25
2.1.11 Penelitian Terdahulu .....	27
2.2 Kerangka Pemikiran .....	44
<b>BAB III METODE PENELITIAN .....</b>	<b>45</b>
3.1 Jenis Penelitian .....	45
3.2 Operasionalisasi Variabel.....	46
3.3 Tahapan Penelitian .....	48
3.4 Populasi dan Sampel .....	49
3.5 Pengumpulan Data dan Sumber Data .....	52
3.6 Teknik Analisis Data.....	53
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....</b>	<b>55</b>
4.1 Hasil Penelitian .....	55
4.1.1 Pembentukan Portofolio Optimal dengan Model Indeks Tunggal.....	55
4.1.2 Pembentukan Portofolio Optimal dengan <i>Capital Asset Pricing Model</i> .....	78
4.1.3 Evaluasi Kinerja Pembentukan Portofolio .....	91
4.2 Pembahasan Hasil Penelitian .....	94
4.2.1 Pembentukan Portofolio dengan Model Indeks Tunggal .....	94
4.2.2 Pembentukan Portofolio dengan CAPM.....	96
4.2.3 Evaluasi Perbandingan Kinerja Pembentukan Portofolio Model Indeks Tunggal dan CAPM.....	98

<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN .....</b>	<b>101</b>
5.1 Kesimpulan .....	101
5.2 Saran.....	102
5.2.1 Saran Teoritis .....	102
5.2.2 Saran Praktis .....	102
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>104</b>
<b>LAMPIRAN.....</b>	<b>107</b>