

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN	i
PERNYATAAN.....	ii
ABSTRAK	iii
<i>ABSTRACT</i>	iv
KATA PENGANTAR	v
UCAPAN TERIMA KASIH.....	vi
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	xi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Identifikasi dan Rumusan Masalah.....	10
1.2.1 Identifikasi Masalah.....	10
1.2.2 Rumusan Masalah.....	11
1.3 Tujuan Penelitian.....	12
1.4 Kegunaan Penelitian	12
BAB II KAJIAN PUSTAKA DAN KERANGKA PEMIKIRAN PENELITIAN ...	14
2.1 Kajian Pustaka.....	14
2.1.1 Pengembalian (<i>Return</i>)	14
2.1.2 Risiko.....	15
2.1.3 Portofolio	17

2.1.4 <i>Single Index Model</i>	23
2.1.5 Indeks LQ-45	30
2.1.6 Tinjauan Peneliti Terdahulu.....	32
2.2 Kerangka Pemikiran	35
BAB III METODE PENELITIAN.....	37
3.1 Lokasi dan Subjek Populasi/Sampel Penelitian.....	37
3.2 Desain Penelitian	41
3.3 Metode Penelitian	42
3.4 Definisi Variabel dan Operasionalisasi Variabel.....	42
3.4.1 Definisi Variabel.....	42
3.4.2 Operasionalisasi Variabel	43
3.5 Teknik Pengumpulan Data.....	44
3.6 Teknik Analisis Data.....	45
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	48
4.1 Hasil Penelitian	48
4.1.1 Fluktuasi Harga Saham.....	48
4.1.2 Fluktuasi <i>Return</i> Pasar dan <i>Return</i> Saham	52
4.1.3 <i>Beta</i> Saham dan Alpha.....	55
4.1.4 Perhitungan risiko saham individual.....	57
4.1.5 Portofolio Optimal <i>Single Index Model</i>	58
4.2 Pembahasan	62

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	67
5.1 Kesimpulan	67
5.2 Saran	67
<u>DAFTAR PUSTAKA</u>	68
<u>LAMPIRAN</u>	70

