

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN I.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN II	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRAK.....	v
ABSTRACT	vi
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR LAMPIRAN.....	x
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	6
1.3 Batasan Masalah	7
1.4 Tujuan Penelitian	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	9
2.1 Saham	9
2.2 <i>Trading Limit</i>	9
2.3 <i>Dividend Yield</i>	10
2.4 <i>Return Saham</i>	11
2.5 Korelasi Saham	12
2.6 Portofolio Saham	13
2.6.1 <i>Return Portofolio</i>	14
2.6.2 Risiko Portofolio	15
2.7 Optimasi Bobot Portofolio Saham.....	17

2.7.1	Model <i>Mean-Semivariance</i>	17
2.7.2	Metode Karush-Kuhn-Tucker (KKT)	22
2.8	<i>Value at Risk</i>	24
BAB III METODOLOGI PENELITIAN		25
3.1	Jenis dan Sumber Data	25
3.2	Variabel Penelitian.....	25
3.3	Tahapan Analisis Data.....	26
3.4	Diagram Alir Analisis Data.....	27
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		29
4.1	<i>Return Saham</i>	29
4.2	<i>Expected Return</i>	30
4.3	<i>Dividend Yield</i>	31
4.4	Korelasi Saham	32
4.5	Pemilihan Saham Terpilih	33
4.6	Proses Analisis Pembentukan Portofolio	34
4.7	<i>Return Portofolio</i>	42
4.8	Interpretasi Keuntungan Dividen.....	43
4.9	<i>Value at Risk</i>	44
BAB V KESIMPULAN.....		47
DAFTAR PUSTAKA		49
LAMPIRAN		53