

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 GAMBAR.....	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah	6
1.3 Batasan Masalah.....	6
1.4 Tujuan Penelitian.....	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	8
2.1 Investasi.....	8
2.2 Pasar Modal	9
2.3 IDX30	9
2.4 Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	11
2.5 <i>Return</i>	12
2.6 Aset Bebas Risiko.....	13
2.7 Pemilihan Saham Penyusun Portofolio Menggunakan CAPM	14
2.8 Uji Asumsi Normalitas	16
2.9 <i>Single Index Model (SIM)</i>	17
2.10 Menentukan Nilai <i>Excess Return to Beta (ERB)</i> Masing-Masing Saham.....	19
2.11 Kandidat Portofolio Optimal Menggunakan SIM	20
2.11.1 Mengurutkan ERB	20
2.11.2 Nilai <i>C_i</i>	21
2.11.3 <i>Cut-Off Point (C*)</i>	21
2.11.4 Saham Kandidat Portofolio Optimal.....	22
2.12 Menentukan Bobot Saham Pembentuk Portofolio Optimal	22

2.13	<i>Return</i> Portofolio	23
2.14	Risiko Portofolio	24
2.15	R-GUI (<i>Graphical User Interface</i>).....	24
BAB III METODOLOGI PENELITIAN		27
3.1	Jenis dan Sumber Data	27
3.2	Variabel Penelitian	27
3.3	Tahapan Analisis Data.....	27
3.4	Diagram Alir Penelitian.....	30
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		32
4.1	Deskripsi Data, Perhitungan <i>Return</i> dan Besarnya Proporsi Saham	32
4.1.1	<i>Return</i> Saham.....	32
4.1.2	<i>Return</i> Aset Bebas Risiko	35
4.2	Pemilihan Saham Penyusun Portofolio Menggunakan CAPM	36
4.2.1	Saham Terbaik Model CAPM.....	37
4.2.2	Uji Asumsi Normalitas.....	38
4.3	Menghitung <i>Expected Return Single Index Model (SIM)</i>	40
4.4	Menentukan Nilai ERB Masing-Masing Saham	41
4.5	Kandidat Portofolio Optimal Menggunakan SIM	42
4.4.1	Mengurutkan ERB	42
4.4.2	Nilai C_i	43
4.4.3	<i>Cut-Off Point (C*)</i>	44
4.4.4	Saham Kandidat Portofolio Optimal.....	44
4.6	Bobot pada Kandidat Portofolio Optimal menggunakan SIM	45
4.7	<i>Expected Return</i> dan Risiko Portofolio Menggunakan <i>Single Index Model</i>	47
4.8	R-GUI (<i>Graphical User Interface</i>).....	47
BAB IV KESIMPULAN DAN SARAN		57
5.1	Kesimpulan.....	57
5.2	Saran.....	57
DAFTAR PUSTAKA		58
LAMPIRAN.....		61