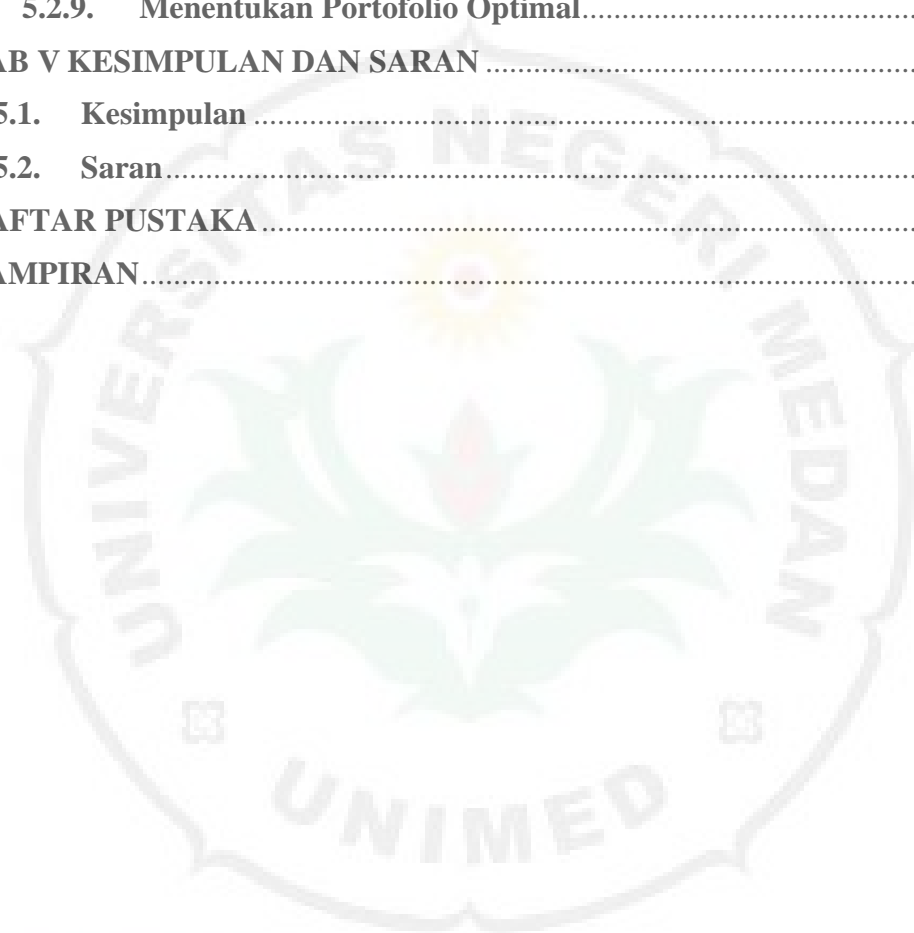


DAFTAR ISI

LEMBAR PERSEMBAHAN	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
RIWAYAT HIDUP	iii
LEMBAR PERNYATAAN ORISINALITAS	iv
LEMBAR PERSETUJUAN PUBLIKASI	v
ABSTRAK	vi
ABSTRACT	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR ISI	xi
DAFTAR GAMBAR	xiv
DAFTAR TABEL	xv
DAFTAR LAMPIRAN	xvi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Identifikasi Masalah	6
1.3. Ruang Lingkup Masalah	6
1.4. Rumusan Masalah	7
1.5. Batasan Masalah	7
1.6. Tujuan Penelitian	7
1.7. Manfaat Penelitian	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	9
2.1. Investasi	9
2.1.1. Pengertian Investasi	9
2.1.2. Jenis-jenis Investasi	9
2.1.3. Tujuan Sistem Investasi	10
2.1.4. Kebijakan Akuntansi Investasi	10
2.1.5. Proses Investasi	10
2.1.6. Investasi di Pasar Modal	12
2.2. Saham	12
2.3. Perbankan	12
2.3.1. Pengertian Perbankan	12

2.3.2.	Jenis-jenis Bank	13
2.3.3.	Fungsi Utama Bank	13
2.4.	Teori Portofolio	14
2.4.1.	Konsep Dasar Portofolio	14
2.4.2.	Tingkat Pengembalian yang Diharapkan	14
2.4.3.	Portofolio yang Efisien dan Optimal	14
2.5.	Capital Asset Pricing Model (CAPM)	15
2.5.1.	<i>Return</i>	17
2.5.2.	<i>Expected return</i>	19
2.5.3.	<i>Return Bebas Risiko (Risk Free Rate)</i>	19
2.5.4.	<i>Return Pasar</i>	19
2.5.5.	Risiko	20
2.5.6.	Hubungan Risiko dan <i>Return</i> dalam CAPM	22
2.5.7.	Koefisien Beta	23
2.5.8.	Nilai Kovarian	25
2.5.9.	Bobot/ Proporsi Dana Portofolio	25
2.5.10.	<i>Return</i> Portofolio	26
2.6.	<i>R-Computation</i>	27
BAB III METODE PENELITIAN		29
3.1.	Tempat dan Waktu Penelitian	29
3.2.	Jenis Penelitian	29
3.3.	Populasi dan Sampel	29
3.4.	Variabel Penelitian	30
3.5.	Desain Penelitian	30
3.6.	Teknik Pengumpulan Data	30
3.7.	Prosedur Penelitian	31
3.8.	Analisis data	34
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		35
5.1.	Data Penelitian	35
5.2.	Proses Analisis	36
5.2.1.	Nilai <i>Return</i> Saham Individu	36
5.2.2.	Menghitung <i>Expected return</i>	40
5.2.3.	Menghitung Risiko Tiap Saham	42
5.2.4.	Tingkat Pengembalian Pasar	43

5.2.5.	Nilai Beta Masing-masing Saham.....	46
5.2.6.	Menentukan Saham yang Efisien	47
5.2.7.	Menghitung Kovarian antar Saham	48
5.2.8.	Menentukan Proporsi Dana, Risiko, dan <i>Return</i> Portofolio	49
5.2.9.	Menentukan Portofolio Optimal.....	51
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN		53
5.1.	Kesimpulan	53
5.2.	Saran.....	54
DAFTAR PUSTAKA.....		53
LAMPIRAN.....		55



THE
Character Building
 UNIVERSITY