

DAFTAR ISI

ABSTRACT	i
ABSTRAK	ii
KATA PENGANTAR	iii
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Identifikasi Masalah.....	10
1.3 Rumusan Masalah	11
1.4 Tujuan Penelitian	11
1.5 Manfaat Penelitian	12
1.6 Pembatasan Masalah	13
1.7 Sistematika Penulisan	14
BAB II KAJIAN PUSTAKA	15
2.1 Kajian Pustaka	15
2.1.1 Investasi	15
2.1.1.1 Pengertian Investasi	15
2.1.1.2 Tujuan Investasi	16
2.1.1.3 Bentuk-Bentuk Investasi.....	17

2.1.1.4 Prinsip Investasi	18
2.1.1.5 Manfaat Investasi	19
2.1.2 Pasar Modal	20
2.1.2.1 Pengertian Pasar Modal	20
2.1.2.2 Kategori Pasar Modal	21
2.1.2.3 Fungsi Pasar Modal	23
2.1.2.4 Instrumen Pasar Modal	24
2.1.2.5 Manfaat Pasar Modal	26
2.1.3 Saham.....	27
2.1.3.1 Pengertian Saham	27
2.1.3.2 Jenis-Jenis Saham	28
2.1.3.3 Harga Saham.....	30
2.1.3.4 Faktor-Faktor yang menyebabkan Naik dan Turunnya harga Saham.....	33
2.1.3.5 Keuntungan Memiliki Saham	33
2.1.3.6 Risiko Saham	35
2.1.4 Analisis Saham.....	36
2.1.4.1 Analisis teknikal	36
2.1.4.2 Analisis Fundamental	38
2.1.5 Indeks Saham	42
2.1.6 Return dan Risiko	49
2.1.6.1 Return.....	49
2.1.6.2 Risiko	51

2.1.7 Analisis Kinerja	54
2.1.7.1 Indeks Sharpe.....	55
2.1.7.2 Indeks Treynor.....	56
2.1.7.3 Indeks Jensen	57
2.1.8 Penelitian Terdahulu	58
2.2 Kerangka Pemikiran.....	61
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	64
3.1 Metode Penelitian	64
3.2 Metode Pengukuran Kinerja dan Risiko	65
3.3 Sumber Data dan Cara Penentuan Data	68
3.3.1 Sumber Data.....	68
3.3.2 Metode Pengumpulan Data.....	69
3.3.3 Cara penentuan Data	70
3.3.3.1 Populasi	70
3.3.3.2 Sampel	72
3.4 Perancangan dan Analisis Data.....	74
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	78
4.1 Gambaran Umum Indeks Saham	78
4.2 Hasil Penelitian	81
4.2.1 Analisis Deskriptif	81
4.2.1.1 Perkembangan Tingkat Return Setiap Indeks Saham.....	81
4.2.1.2 Perkembangan Tingkat Risiko Setiap Indeks Saham	92
4.2.1.3 Perkembangan Tingkat Risiko Beta Setiap Indeks Saham....	103

4.2.1.4 Perkembangan Tingkat Risk Free Setiap Indeks Saham	114
4.2.2 Analisis Kuantitatif	115
4.2.2.1 Metode Indeks Sharpe	115
4.2.2.2 Metode Indeks Treynor.....	118
4.2.2.3 Metode Indeks Jensen.....	120
4.3 Pembahasan.....	122
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	125
5.1 Kesimpulan	125
5.2 Saran	127
DAFTAR PUSTAKA.....	129
LAMPIRAN.....	131