

DAFTAR ISI

ABSTRAK	i
KATA PENGANTAR.....	ii
DAFTAR ISI.....	iv
DAFTAR TABEL	vi
DAFTAR GAMBAR.....	vii
DAFTAR LAMPIRAN.....	viii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1.Latar Belakang	1
1.2.Identifikasi Masalah.....	3
1.3.Tujuan	3
1.4.Sistematika Penulisan	3
BAB II LANDASAN TEORI	5
2.1.Saham.....	5
2.2. <i>Return</i> Saham.....	5
2.3.Risiko Saham	7
2.3.1. Deviasi Standar (<i>standar deviation</i>)	8
2.3.2. Kovarian <i>Return</i> Saham.....	9
2.4.Regresi Linear Sederhana	9
2.5.Teori Portofolio.....	12
2.6.Portofolio Optimal	13

2.7.Sudut Portofolio Optimal	14
2.8.Uji T	14
BAB III PEMBAHASAN	16
3.1.Model Indeks Tunggal (<i>Single Index Model</i>).....	17
3.1.1. Varians <i>Return</i> Saham	21
3.1.2. Kovarian Antara Dua <i>Return</i> Saham	22
3.1.3. Pengaruh Perubahan <i>Return</i> Pasar terhadap <i>Return</i> Saham	23
3.2.Memilih Saham Efisien menurut Model Indeks Tunggal.....	24
3.3.Pemilihan Saham untuk Portofolio Optimal	26
3.4.Proporsi untuk Saham di Portofolio Optimal.....	35
3.5.Return Ekspektasi dan Risiko Portofolio Optimal	36
3.6.Aplikasi Model Indeks Tunggal dalam Membentuk Portofolio Optimal	37
3.6.1. Data dan Metode Analisis	39
3.6.1.1. Uji Normal.....	40
3.6.1.2. Uji T.....	41
3.6.2. Pemilihan Saham Optimal	44
3.6.2.1. Memilih Saham Efisien	44
3.6.2.2. Memilih Saham Optimal	48
3.6.3. Proporsi, Return Ekspektasi dan Risiko Portofolio Optimal.....	49

3.6.4. Uji Korelasi51

BAB IV KESIMPULAN.....53

DAFTAR PUSTAKA.....ix

