

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	ii
LEMBAR PENGESAHAN	iii
HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS.....	iv
HALAMAN PERNYATAAN	v
KATA PENGANTAR	vi
ABSTRAK	viii
ABSTRACT	ix
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR TABEL	xiv
BAB I	15
PENDAHULUAN	15
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian	15
1.2 Latar Belakang Penelitian	16
1.3 Perumusan Masalah.....	20
1.4 Tujuan Penelitian.....	21
1.5 Manfaat Penelitian.....	22
1.5.1 Aspek Teoritis	22
1.5.2 Aspek Akademis.....	22
1.6 Sistematika Penulisan Tugas Akhir.....	22
BAB II.....	24
TINJAUAN PERPUSTAKAAN	24

2.1 Teori dan Penelitian Terdahulu	24
2.1.1 Investasi.....	24
2.1.2 Saham.....	24
2.1.3 Return.....	25
2.1.4 Volatilitas	26
2.1.5 Risiko	27
2.1.6 Strategi Momentum (MoM).....	28
2.2 Kerangka Pemikiran	41
2.2.1 Hubungan Beta dengan Kinerja Indeks	41
2.2.2 Hubungan Alpha dengan Kinerja Indeks	42
2.2.3 Hubungan VaR dengan Kinerja Indeks	42
2.2.4 Hubungan Momentum (MoM) dengan Kinerja Indeks	42
2.3 Hipotesis Penelitian	44
BAB III	45
METODE PENELITIAN.....	45
3.1 Jenis Penelitian	45
3.2 Operasionalisasi Variabel.....	46
3.3 Tahapan Penelitian	47
3.4 Populasi dan Sampel	48
3.5 Pengumpulan Data dan Sumber Data.....	49
3.6 Teknik Analisis Data	49
3.6.1 Perhitungan Awal.....	51
3.6.2 Uji Statistik Deskriptif	52
3.6.3 Uji Kelayakan Model	52

3.6.4 Uji Regresi Logistik	53
BAB IV	55
HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	55
4.1 Karakteristik Data.....	55
4.2 Hasil Penelitian.....	59
4.2.1 Uji Kelayakan Model	59
4.2.2 Pengujian Hipotesis.....	60
4.3 Pembahasan Hasil Penelitian.....	65
4.3.1 Pengaruh Beta terhadap Kinerja Indeks	65
4.3.2 Pengaruh Alpha terhadap Kinerja Indeks	66
4.3.3 Pengaruh <i>Value at Risk</i> terhadap Kinerja Indeks	67
4.3.4 Pengaruh Momentum terhadap Kinerja Indeks.....	68
BAB V	70
KESIMPULAN DAN SARAN.....	70
5.1 kesimpulan.....	70
5.2 Saran	70
LAMPIRAN	72
DAFTAR PUSTAKA	80