

DAFTAR ISI

HALAMAN PENYATAAN	III
KATA PENGANTAR.....	IV
DAFTAR ISI.....	V
DAFTAR TABEL	VII
DAFTAR GAMBAR.....	X
ABSTRAK	XI
ABSTRACT	XII
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1.Gambaran Umum Objek Penelitian	1
1.2.Latar Belakang	4
1.3.Perumusan Masalah	9
1.4.Tujuan Penelitian	9
1.5.Manfaat Penelitian	10
1.6.Aspek Teoritis	10
1.7.Aspek Akademis	10
1.8.Sistematika Penulisan Tugas Akhir	10
BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN LINGKUP PENELITIAN	12
2.1.Tinjauan Pustaka	12
2.1.1. Portofolio	12
2.1.2. Return	12
2.1.3. Risiko	13
2.1.4. Beta	12
2.1.5. Capital Asset Pricing Model (Cpam).....	13
2.1.6. Smart Beta	13
2.1.7. Kapitalisasi Pasar	14
2.1.8. Analisis Kinerja Sharpe	15
2.2. Penelitian Terdahulu	16
2.3.Kerangka Pemikiran.....	26
BAB III METODE PENELITIAN	28
3.1. Karakteristik Penelitian	28
3.2.Operasional Variabel	29
3.3.Tahapan Penelitian.....	29
3.4 Populasi Dan Sample	30
3.5 Pengumpulan Data	31
3.6 Teknis Analisis Data	31

BAB IV HASIL DAN PEMBAHSAN.....	32
4.1. Karakteristik Data.....	32
4.2. Hasil Penelitian.....	32
4.2.1. Menghitung Tingkat Pengembalian Saham Individu.....	33
4.2.2. Menghitung Tingkat Risiko Saham Individu.....	34
4.2.3. Menghitung Beta Saham Individu.....	34
4.2.4. Menghitung Risiko Tidak Sistematis.....	35
4.2.5. Menentukan Risk Free Rate.....	36
4.2.6. Klasifikasi Kelompok Volatility.....	37
4.2.7. Menentukan Pembobotan Saham Pada Kelompok Volatility.....	45
4.2.8. Menghitung Beta Kelompok Volatility.....	45
4.2.9. Menghitung Resiko Tidak Sistematis Kelompok Volatility.....	53
4.2.10. Perhitungan Return Dan Resiko Kelompok Volatility.....	61
4.2.11. Evaluasi Kinerja Sharpe.....	66
4.3. Pembahasan Hasil Penelitian.....	67
4.3.1. Pembahasan Portofolio High Volatility.....	68
4.3.2. Pembahasan Low Volatility.....	69
4.3.3. Portofolio Terbaik.....	71
BAB V KEIMPULAN DAN SARAN.....	76
5.1. Kesimpulan.....	76
5.2. Saran.....	76
5.2.1. Aspek Teoritis.....	76
5.2.2. Aspek Praktis.....	76
DAFTAR PUSTAKA.....	79
LAMPIRAN.....	83