

DAFTAR ISI

	Hal
Halaman Judul	i
Halaman Pengesahan	ii
Halaman Motto	iii
Halaman Persembahan	iv
Kata Pengantar	v
Daftar Isi	vii
Daftar Tabel	x
Daftar Gambar	xi
BAB I. Pendahuluan	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Rumusan Masalah	7
1.3. Tujuan Penelitian	7
1.4. Manfaat Penelitian	8
1.5. Hipotesa Penelitian	8
1.6. Metodologi Penelitian	8
BAB II. Landasan Teori	14
2.1. Teori Investasi	14
2.2. Teori Portofolio	22

2.3. Beta sebagai Pengukur Risiko Saham	25
2.4. Model Penentuan Harga Saham	29
2.4.1. Model Indeks Tunggal	29
2.4.2. Capital Asset Pricing Model (CAPM)	33
2.5. Mengestimasi Beta	37
BAB III. Gambaran Umum Perusahaan	39
3.1. PT Medco Energi Corporation Tbk. (MEDC)	41
3.2. PT Aneka Tambang (Persero) Tbk. (ANTM)	45
3.3. PT International Nickel Indonesia Tbk. (INCO)	48
3.4. PT Tambang Timah (Persero) Tbk. (TINS)	51
3.5. PT Citatah Industri Marmer Tbk. (CTTH)	55
3.6. PT Alter Abadi Tbk. (ALDI)	57
3.7. Bursa Efek Jakarta	60
BAB IV Analisa Data dan Hasil Penelitian	69
4.1. Tingkat keuntungan saham	70
4.2. Tingkat Keuntungan Indeks Pasar	74
4.3. Hasil dan Analisa Risiko Sistematis (Beta)	76
BAB V Kesimpulan dan Saran	91
5.1. Kesimpulan	91
5.2. Saran-saran	92

Daftar Pustaka

Lampiran



DAFTAR TABEL

Tabel	Hal
3.8. Daftar Harga Saham dan IHSG	67
4.1. Tingkat Keuntungan Saham Perusahaan Sektor Pertambangan	71
4.2. Rata-rata Tingkat Keuntungan Masing-masing Saham Sektor Pertambangan selama Periode Penelitian	73
4.3. Tingkat Keuntungan Indeks Pasar	75
4.4. Tingkat Risiko Sistematis (Beta) dan Alpha Masing-masing Saham Sektor Pertambangan selama Periode Penelitian	77
4.5. Rekapitulasi Hasil Analisa	89

DAFTAR GAMBAR

Gambar	Hal
2.1. Proses Pengambilan Keputusan Investasi	19
2.3. Hubungan excess return of a stock dengan excess return of market portofolio	25
2.4. Pengurangan Risiko dengan Diversifikasi	27
2.5. Penggambaran Beta	38
3.7. Skema Proses Perdagangan di Bursa Efek Jakarta	62

