

DAFTAR ISI

PERNYATAAN BEBAS PLAGIAT	i
LEMBAR PENGESAHAN	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
ABSTRAK	v
ABSTRACT	vi
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR.....	x
DAFTAR LAMPIRAN	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Identifikasi Masalah	8
1.3 Tujuan Penelitian	8
1.4 Manfaat Penelitian	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN PENDEKATAN MASALAH.....	10
2.1 Tinjauan Pustaka.....	10
2.1.1 Investasi.....	10
2.1.2 Pasar Modal.....	14
2.1.3 Saham.....	16
2.1.4 Portofolio.....	22
2.1.5 Beberapa Metode Menentukan Keputusan Investasi	22
2.2 Penelitian Terdahulu	30
2.3 Pendekatan Masalah	34
BAB III METODE PENELITIAN	32
3.1 Tempat dan Waktu Penelitian.....	32
3.2 Jenis Penelitian	32
3.3 Metode Penelitian	33

3.3.1 Metode Pengumpulan Data	35
3.4 Definisi dan Operasional Variabel.....	35
3.5 Kerangka Analisis.....	37
BAB IV GAMBARAN UMUM OBJEK PENELITIAN	42
4.1 Perusahaan Sektor Pertanian.....	42
4.1.1 Harga Penutupan Saham Sektor Pertanian.....	47
4.1.2 Harga Penutupan Indeks Harga Saham Gabungan	49
BAB V HASIL DAN PEMBAHASAN	50
5.1 Nilai <i>Return</i> (R_i) dan Risiko (β_i) Tertinggi dan Terendah serta Saham-saham yang Memiliki <i>Return</i> Positif/Negatif dan Risiko Positif/Negatif pada Perusahaan Sektor Pertanian di Bursa Efek Indonesia (BEI).....	50
5.1.1 Analisis <i>Return Individual</i> (R_i).....	50
5.1.2 Analisis <i>Return Market</i> (R_m).....	53
5.1.3 Analisis <i>Risk Free Rate</i> (R_f)	56
5.1.4 Analisis Risiko Sistematis atau Beta (β_i)	58
5.2 Nilai Tingkat Pengembalian yang Diharapkan (<i>Expected Return</i>) Tertinggi/Terendah serta <i>Expected Return</i> Positif/Negatif pada Saham Sektor Pertanian di Bursa Efek Indonesia (BEI)	61
5.2.1 Analisis <i>Expected Return Individual</i> ($E(R_i)$)	61
5.3 Penilaian dan Pengelompokan Saham-saham Sektor Pertanian yang Efisien dan Tidak Efisien Berdasarkan Metode <i>Capital Asset Pricing Model</i> (CAPM)	62
5.3.1 Daftar Saham-saham Efisien, Tidak Efisien dan Keputusan Investasi	62
5.3.2 Penggambaran Grafik <i>Security Market Line</i> (SML).....	65
BAB VI KESIMPULAN DAN SARAN.....	67
6.1 Kesimpulan.....	67
6.2 Saran	68
LAMPIRAN.....	79