

DAFTAR ISI

	Halaman
JUDUL	i
ABSTRAK	iii
LEMBAR PENGESAHAN	v
PERNYATAAN ORISINALITAS	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR ISI	x
DAFTAR LAMPIRAN	xii
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
 BAB I. PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang	1
B. Identifikasi Masalah	11
C. Pembatasan Masalah	12
D. Perumusan Masalah	12
E. Kegunaan Penelitian.....	13
 BAB II. KERANGKA TEORITIK	
A. Deskripsi Konseptual	15
1. Teori Portofolio	15
2. Teori <i>Efficient Market Hypothesis</i>	16
3. Reksa Dana	17
3.1 Bentuk Hukum.....	18
3.2 Sifat Reksa Dana	20
3.3 Jenis Reksa Dana	21
3.4 Manfaat Reksa Dana.....	22
3.5 Nilai Aktiva Bersih (NAB).....	23
4. Kinerja Reksa Dana	24
5. Kebijakan Alokasi Aset	31
6. Pemilihan Saham	32
7. Tingkat Risiko	34
8. Ukuran Reksa Dana	36
B. Hasil Penelitian Yang Relevan	37
C. Kerangka Teoritik	41
D. Perumusan Hipotesis	44
 BAB III. METODOLOGI PENELITIAN	
A. Tujuan Penelitian	51
B. Objek dan Ruang Lingkup Penelitian	51
C. Metode Penelitian.....	52

D. Jenis dan Sumber Data	52
E. Operasionalisasi Variabel.....	54
F. Teknik Analisis Data.....	62
 BAB IV. HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
A. Deskriptif Data	70
1. Hasil Uji Statistik Deskriptif	71
B. Pengujian Hipotesis.....	76
2. Uji Asumsi Klasik	76
2.1 Uji Normalitas	76
2.2 Uji Multikolonieritas	78
2.3 Uji Heterokedasitas	79
2.4 Uji Autokorelasi	81
3. Regresi Linier Berganda	83
4. Hasil Uji Hipotesis	89
4.1 Hasil Uji T (Parsial)	89
4.2 Hasil Uji Koefisien Determinasi	92
4.3 Hasil Uji F (Simultan).....	92
C. Pembahasan.....	
1. Pengaruh Alokasi Aset terhadap Kinerja Reksadana	93
2. Pengaruh <i>Stock Selection</i> terhadap Kinerja Reksadana ..	97
3. Pengaruh Tingkat Risiko terhadap Kinerja Reksadana ..	99
4. Pengaruh Ukuran Reksadana terhadap Kinerja Reksadana	102
 BAB V. KESIMPULAN, IMPLIKASI, DAN SARAN	
A. Kesimpulan	106
B. Implikasi	107
C. Saran	109
 DAFTAR PUSTAKA	 112
LAMPIRAN.....	115
RIWAYAT HIDUP	128

DAFTAR LAMPIRAN

No.	Judul Lampiran	Halaman
	Lampiran 1 Daftar Sampel Penelitian	116
	Lampiran 2 Contoh Data Perhitungan Variabel.....	117
	Lampiran 3 Rekap Data Penelitian	120
	Lampiran 4 Hasil Regresi SPSS.....	124

DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel II.1 Perbedaan Reksa Dana PT dengan Kontrak Kolektif	18
Tabel II.2 Penelitian Terdahulu.....	37
Tabel IV.1 Jumlah Sampel Penelitian.....	71
Tabel IV.2 Uji Statistik Deskriptif.....	72
Tabel IV.3 Uji Komolgrov - Smirnov.....	78
Tabel IV.4 Uji <i>Tolerance</i> dan VIF.....	79
Tabel IV.5 Uji Park.....	81
Tabel IV.6 Uji Durbin – Watson.....	82
Tabel IV.7 Regresi Linier Berganda.....	83
Tabel IV.8 Kinerja Reksadana Saham dan Perbandingan Th. 2011.....	86
Tabel IV.9 Kinerja Reksadana Saham dan Perbandingan Th. 2012.....	87
Tabel IV. 10 Kinerja Reksadana Saham dan Perbandingan Th. 2013.....	88
Tabel IV. 11 Uji T (Parsial).....	90
Tabel IV.12 Uji Koefisien Determinasi.....	92
Tabel IV.13 Uji F (Simultan).....	93
Tabel IV.14 Perbandingan NAB dengan Return Reksadana.....	104

DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar I.1 Resume Aktivitas Reksa Dana Tahun 2004-2013	2
Gambar I.2 Komposisi NAB per 28 Februari 2014	5
Gambar II.1 Kerangka Pemikiran	43
Gambar IV.1 Uji Normal Plot.....	77
Gambar IV.2 Grafik Scatterplot.....	80