

DAFTAR ISI

| | |
|------------------------------------|-------|
| ABSTRAK | .iii |
| ABSTRACT | .iv |
| LEMBAR PENGESAHAN | .v |
| LEMBAR ORISINALITAS | .vi |
| KATA PENGANTAR..... | .vii |
| DAFTAR ISI..... | .ix |
| DAFTAR GAMBAR..... | .xii |
| DAFTAR TABEL..... | .xiii |
| DAFTAR LAMPIRAN | .xiv |
| BAB I PENDAHULUAN | |
| A. Latar Belakang Penelitian | 1 |
| B. Pembatasan Masalah | 12 |
| C. Perumusan Masalah | 13 |
| D. Kegunaan Penelitian..... | 13 |
| BAB II KAJIAN TEORITIK | |
| A. Deskriptif Konseptual..... | 15 |
| 1. Teori Investasi..... | 15 |
| 2. Teori Portofolio..... | 16 |
| 3. Metode Sharpe | 19 |
| 4. Reksadana | 20 |

| | |
|---|----|
| 5. Kinerja Reksadana Saham..... | 28 |
| 6. Kebijakan Alokasi Aset..... | 36 |
| 7. Tingkat Risiko..... | 39 |
| 8. Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) | 41 |
| B. Hasil Penelitian Yang Relevan..... | 43 |
| C. Kerangka Teoritik | 47 |
| D. Perumusan Hipotesis..... | 52 |

BAB III METODE PENELITIAN

| | |
|--|----|
| A. Tujuan Penelitian | 56 |
| B. Objek dan Ruang Lingkup Penelitian | 56 |
| C. Metode Penelitian..... | 56 |
| D. Populasi dan Sampel | 58 |
| E. Operasionalisasi Variabel Penelitian..... | 59 |
| F. Teknik Analisis Data..... | 64 |

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

| | |
|-----------------------------------|----|
| A. Deskripsi Data..... | 71 |
| 1. Uji Statistik Deskriptif | 71 |
| B. Pengujian Hipotesis..... | 76 |
| 1. Uji Asumsi Klasik | 76 |
| a. Uji Normalitas..... | 76 |
| b. Uji Multikolinieritas..... | 78 |
| c. Uji Heteroskedastisitas..... | 79 |
| d. Uji Autokorelasi | 81 |

| | |
|---|------------|
| 2. Uji Regresi Linier Berganda | 82 |
| 3. Uji Statistik F | 84 |
| 4. Uji Koefisien Determinasi..... | 85 |
| 5. Uji Statistik t | 86 |
| C. Pembahasan | 88 |
| BAB V KESIMPULAN IMPLIKASI DAN SARAN | 95 |
| DAFTAR PUSTAKA..... | 100 |
| LAMPIRAN..... | 102 |
| DAFTAR RIWAYAT HIDUP | 128 |

DAFTAR GAMBAR

| | |
|---|----|
| Gambar II. 1 Kerangka Konseptual | 52 |
| Gambar IV.1 Hasil Uji Normalitas P-Plots..... | 77 |
| Gambar IV.2 Hasil Uji Scatterplot..... | 80 |

DAFTAR TABEL

| | |
|---|----|
| Tabel II.1 Literatur Review..... | 43 |
| Tabel III.1 Hasil Pemilihan Sampel | 58 |
| Tabel IV.1 Hasil Analisis Statistik Deskriptif..... | 72 |
| Tabel IV.2 Hasil Uji Normalitas | 78 |
| Tabel IV.3 Hasil Uji Multikolinieritas | 79 |
| Tabel IV.4 Hasil Uji Heteroskedastisitas | 81 |
| Tabel IV.5 Hasil Uji Autokorelasi | 82 |
| Tabel IV.6 Hasil Uji Regresi Linier Berganda..... | 82 |
| Tabel IV.7 Hasil Uji Statistik F..... | 84 |
| Tabel IV.8 Hasil Uji Koefisien Determinasi..... | 85 |
| Tabel IV.9 Hasil Uji Statistik t..... | 87 |

DAFTAR LAMPIRAN

| | |
|--|-----|
| Lampiran 1 Daftar Sampel Penelitian | 102 |
| Lampiran 2 Data Perhitungan Variabel..... | 103 |
| Lampiran 3 Rekap Data Penelitian | 121 |
| Lampiran 4 Hasil Regresi SPSS..... | 123 |
| Lampiran 5 Kartu Konsultasi Pembimbingan Penulisan Skripsi | 126 |