

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN	i
HALAMAN PERNYATAAN PERSETUJUAN PUBLIKASI	ii
HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS	iii
HALAMAN HASIL PLAGIASI.....	iv
ABSTRAK.....	v
ABSTRACT	vi
KATA PENGANTAR.....	vii
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR GAMBAR.....	xi
DAFTAR TABEL	xii
BAB 1 PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	6
1.3 Tujuan Penelitian.....	6
1.4 Manfaat Penelitian.....	7
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA.....	8
2.1 Landasan Teori	8
2.1.1 Investasi	8
2.1.2 Teori Portofolio	9
2.1.3 Model Indeks Tunggal.....	10
2.1.4 <i>Behavioral Finance</i>	10
2.1.5 Perusahaan Teknologi.....	11
2.2 Penelitian Terdahulu	12
2.3 Kerangka Pemikiran.....	14

2.4	Pembentukan Hipotesis Rasionalitas Investor	15
BAB 3 METODE PENELITIAN.....		17
3.1	Jenis dan Sumber Data	17
3.1.1	Jenis Data	17
3.1.2	Sumber Data.....	17
3.2	Populasi dan Sampel.....	18
3.2.1	Populasi	18
3.2.2	Sampel.....	19
3.3	Teknik Analisis Data.....	20
3.4	Uji Hipotesis.....	28
BAB 4 HASIL & PEMBAHASAN		30
4.1	Gambaran Umum Objek Penelitian.....	30
4.1.1	Bursa Efek Indonesia	30
4.1.2	Perusahaan Sektor Teknologi.....	31
4.1.3	Kondisi Perilaku Rasional dan Irrasional Investor.....	37
4.2	Data Deskriptif	37
4.3	Analisis Data	38
4.3.1	Perhitungan <i>Realized Return</i> , <i>Expected Return</i> , <i>Standart Deviation</i> , Varian Saham Individual dan IHSG	39
4.3.2	Perhitungan <i>Alpha</i> , <i>Beta</i> dan <i>Variance Residual Error</i> Masing-Masing Saham.....	41
4.3.3	Menentukan <i>Return</i> Bebas Risiko.....	42
4.3.4	Perhitungan <i>Excess Return to Beta</i> Masing-Masing Saham.....	43
4.3.5	Perhitungan <i>Delimiter Value</i> Masing-Masing Saham.....	44
4.3.6	Perhitungan <i>Cut-Off Point Value</i> (C*) Masing-Masing Saham.....	45
4.3.7	Penentuan Proporsi Dana Saham Pembentuk Portofolio Optimal.....	47

4.3.8 Perhitungan <i>Expected Return</i> Portofolio	49
4.3.9 Perhitungan <i>Risk</i> Portofolio.....	50
4.4 Pengujian Hipotesis	51
4.5 Pembahasan.....	55
4.5.1 Analisis Penentuan Portofolio Optimal	55
4.5.2 Proporsi Dana Portofolio Optimal.....	56
4.5.3 <i>Return</i> dan Risiko Portofolio Optimal.....	57
4.5.4 Uji Hipotesis Rasionalitas Investor	57
BAB 5 KESIMPULAN	60
5.1 Kesimpulan	60
5.2 Saran	61
DAFTAR PUSTAKA	62
LAMPIRAN	66

