

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN	ii
HALAMAN MOTTO DAN PERSEMBAHAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI	v
DAFTAR TABEL	viii
DAFTAR LAMPIRAN	ix
ABSTRAK	x
BAB I PENDAHULUAN	
A. Alasan Pemilihan Judul	1
B. Perumusan Masalah	5
C. Pembatasan Masalah	6
D. Tujuan Penelitian	7

E. Manfaat Penelitian	7
F. Metodologi Penelitian	
1. Desain Penelitian	8
2. Jenis Data	8
3. Sampel Penelitian	9
4. Teknik Analisis	9
G. Tinjauan Pustaka	13
H. Sistematika Penulisan	14
BAB II KERANGKA TEORI	16
BAB III GAMBARAN UMUM PASAR MODAL INDONESIA	
A. Sejarah dan Perkembangan Pasar Modal Indonesia	
1. Sejarah Pasar Modal Indonesia	26
2. Perkembangan Pasar Modal Indonesia	27
B. Mekanisme Perdagangan di Bursa Efek Jakarta	38
BAB IV PEMBAHASAN	40

BAB V	KESIMPULAN DAN SARAN	
	A. Kesimpulan	54
	B. Saran	57
DAFTAR PUSTAKA		59
LAMPIRAN-LAMPIRAN		61

DAFTAR TABEL

T A B E L		Halaman
IV.1	<i>GAINERS</i> DI BEJ PADA TRIWULAN II 1998	40
IV.2.(1) - IV.2.(8)	<i>RETURN</i> MINGGUAN, <i>EXPECTED RETURN</i> , DAN STANDAR DEVIASI <i>GAINERS</i>	42
IV.3	KORELASI ANTAR <i>RETURN</i> <i>GAINERS</i> YANG EFISIEN	47
IV.4	PORTOFOLIO-PORTOFOLIO SUDUT	49
IV.5	<i>EXPECTED RETURN</i> DAN STANDAR DEVIASI PORTOFOLIO-PORTOFOLIO SUDUT	50

DAFTAR LAMPIRAN

- | | | |
|----------|----|--|
| LAMPIRAN | 1 | Evaluasi Harga Penutupan Saham di Bursa Efek Jakarta pada Triwulan II 1998 |
| LAMPIRAN | 2 | Daftar Harga Penutupan Mingguan <i>Gainers</i> |
| LAMPIRAN | 3 | Daftar <i>Return</i> Mingguan, <i>Expected Return</i> , dan Standar Deviasi <i>Gainers</i> |
| LAMPIRAN | 4 | <i>Gainers</i> yang Efisien dan yang Tidak Efisien |
| LAMPIRAN | 5 | Korelasi antar <i>Return Gainers</i> yang Efisien (r) |
| LAMPIRAN | 6 | Identifikasi Portofolio Sudut (C) |
| LAMPIRAN | 7 | Daftar <i>Expected Return</i> dan Standar Deviasi Portofolio-Portofolio Sudut (C) |
| LAMPIRAN | 8 | Portofolio-Portofolio Sudut |
| LAMPIRAN | 9 | Contoh Penentuan Komposisi Portofolio yang Optimal |
| LAMPIRAN | 10 | Standar Deviasi Portofolio yang Optimal (σ_p^*) |