

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN	ii
HALAMAN PENGESAHAN	iii
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN	iv
HALAMAN MOTTO	v
HALAMAN PERSEMBAHAN	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN	xi
DAFTAR TRANSLITERASI	xii
ABSTRAK BAHASA INDONESIA	xiv
ABSTRAK BAHASA INGGRIS	xv
DAFTAR ISI	xvi
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Identifikasi dan Batasan Masalah	16
C. Rumusan Masalah	17
D. Tujuan Penelitian	18
E. Kegunaan Penelitian	18
F. Penegasan Istilah	20
BAB II LANDASAN TEORI	
A. Investasi	22
B. Saham	30
C. Portofolio	44
D. Pasar Modal	47
E. Kajian Penelitian Terdahulu	56
F. Kerangka Konseptual	61

BAB III METODE PENELITIAN

A. Rancangan Penelitian	63
B. Populasi dan Sampel Penelitian	64
C. Instrumen Penelitian	67
D. Sumber Data dan Teknik Pengumpulan Data	68
E. Analisis Data	71
1. Perhitungan Indeks Tunggal	71
2. Perhitungan Indeks Sharpe	80

BAB IV HASIL PENELITIAN

A. Pasar Modal (Bursa Efek Indonesia)	81
B. Indeks Bisnis-27	86
C. Jakarta Islamic Index	88
D. Portofolio Optimal	91
E. Analisis Data	91
1. Pengujian Indeks Tunggal	91
2. Pengujian Indeks Sharpe	100

BAB V PEMBAHASAN

A. Portofolio Optimal Indeks JII	110
1. Expected Return Portofolio Optimal Indeks JII	111
2. Nilai Risiko Portofolio Optimal Indeks JII	111
B. Portofolio Optimal Indeks Bisnis-27	112
1. Expected Return Portofolio Optimal Indeks Bisnis-27	112
2. Nilai Risiko Portofolio Optimal Indeks Bisnis-27	112
C. Perbandingan Kinerja Portofolio Optimal	113

BAB VI PENUTUP

A. Kesimpulan	118
B. Saran-saran	118

DAFTAR RUJUKAN

LAMPIRAN-LAMPIRAN