ANALISIS RETURN SAHAM DAN RISIKO PADA INVESTASI SAHAM SYARIAH DENGAN MODEL MARKOWITZ DAN MODEL INDEKS TUNGGAL

(Studi Pada Saham Perusahaan yang Terdaftar dalam Jakarta Islamic Indeks di Bursa Efek Indonesia Periode 2019 – 2021)

SKRIPSI



Oleh:

Febiana Wahyuning Wulan NIM. 12406173074

PROGRAM STUDI MANAJEMEN KEUANGAN SYARIAH
JURUSAN BISNIS DAN MANAJEMEN
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS ISLAM
UNIVERSITAS ISLAM NEGERI
SAYYID ALI RAHMATULLAH
TULUNGAGUNG
JULI 2022

ANALISIS RETURN SAHAM DAN RISIKO PADA INVESTASI SAHAM SYARIAH DENGAN MODEL MARKOWITZ DAN MODEL INDEKS TUNGGAL

(Studi Pada Saham Perusahaan yang Terdaftar dalam Jakarta Islamic Indeks di Bursa Efek Indonesia Periode 2019 – 2021)

SKRIPSI

Diajukan Kepada Fakultas Ekonomi Dan Bisnis Islam Untuk Memenuhi Salah Satu Persyaratan Guna Memperoleh Gelar Sarjana dalam Keilmuan Manajemen Keuangan Syariah



Oleh:

Febiana Wahyuning Wulan NIM. 12406173074

PROGRAM STUDI MANAJEMEN KEUANGAN SYARIAH
JURUSAN BISNIS DAN MANAJEMEN
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS ISLAM
UNIVERSITAS ISLAM NEGERI
SAYYID ALI RAHMATULLAH
TULUNGAGUNG
JULI 2022

HALAMAN PERSETUJUAN

Skripsi dengan Judul "Analisis *Return* Saham Dan Risiko Pada Investasi Saham Syariah Dengan Model Markowitz Dan Model Indeks Tunggal" yang ditulis oleh Febiana Wahyuning Wulan, NIM: 12406173074 ini telah diperiksa dan disetujui, serta layak diujikan.

Tulungagung, 8 Juli 2022

Pembimbing,

<u>Dr. Deny Yudiantoro, S. AP., M.M.</u> NIP. 198403052019031011

Mengetahui,

Koordinator Program Studi Manajemen Keuangan Syariah

Hj. Amalia Nuril Hidayati, H., SE, M. Sy.

NIP. 198407132014032002

PENGESAHAN PENGUJI

Skripsi dengan Judul "Analisis *Return* Saham Dan Risiko Pada Investasi Saham Syariah Dengan Model Markowitz Dan Model Indeks Tunggal" yang ditulis oleh Febiana Wahyuning Wulan, NIM: 12406173074 ini telah dipertahankan di depan Dewan Penguji pada: Tanggal: 21 Bulan: Juli Tahun: 2022 telah dinyatakan diterima sebagai salah satu persyaratan untuk memperoleh gelar sarjana dalam keilmuan Manajemen Keuangan Syariah.

Tanda Tangan

Dewan Penguji

Ketua Penguji:

<u>Dr. Deny Yudiantoro, S. AP., M.M.</u> NIP. 198403052019031011

Penguji Utama:

<u>Dr. H. Mashudi, M.Pd.I</u> NIP. 196901312001121003

Sekretaris Penguji:

<u>Dr. Mochamad Chobir Sirad, M.Pd.I</u> NIDN. 2029048102

Mengesahkan,

Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam

1

<u>Dede Nurohman, M. 2</u> 197112182002121003

LAMPIRAN 3

Surat Pernyataan Keaslian Tulisan

SURAT PERNYATAAN KEASLIAN TULISAN

Saya yang bertanda tangan di bawah ini:

Nama

: Febiana Wahyuning Wulan

NIM

: 12406173074

Fakultas

: Ekonomi dan Bisnis Islam

Jurusan

: Manajemen Keuangan Syariah

Menyatakan bahwa skripsi dengan judul "Analisis *Return* dan Risiko pada Investasi Portofolio Saham Pasar Modal Syariah Dengan Model Markowitz Dan Model Indeks Tunggal." ini secara keseluruhan adalah hasil penelitian/karya saya sendiri, kecuali pada bagian-bagian yang dirujuk sumbernya. Jika kemudian hari terbukti bahwa karya ini bukan karya saya sendiri atau melakukan plagiasi, maka saya siap menerima sanksi atas tindakan tersebut sesuai dengan ketentuan yang berlaku.

Tulungagung, 21 Juli 2022 Yang membuat pernyataan,

METERAL FOR TEMPEL

E8E79AJX901237939

Febiana Wahyuning Wulan NIM. 12406173096



KEMENTERIAN AGAMA REPUBLIK INDONESIA UNIVERSITAS ISLAM NEGERI SAYYID ALI RAHMATULLAH TULUNGAGUNG UPT PERPUSTAKAAN

Jalan Mayor Sujadi Timur Nomor 46 Tulungagung - Jawa Timur 66221 Telepon: (0355) 321513 Website: www.perpustakaan.uinsatu.ac.id

SURAT PERNYATAAN KESEDIAAN PUBLIKASI KARYA ILMIAH

Saya yang bertanda tangan dibawah ini:

Nama	. Febiana Wahyuning Wulan
NIM	. 12406173074
Program Studi	. Manajemen Keuangan Syariah
Fakultas	. Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam
Jenis Karya Ilmiah	Skripsi
Demi pengembang	an ilmu pengetahuan, menyetujui untuk memberikan Hak Bebas Royalti
Non-ekslusif (<i>Non-exlusive Royalty-Free Right</i>) kepada UPT Perpustakaan UIN Sayyid Ali Rahmatullah Tulungagung atas karya ilmiah saya berupa (<u>SKTIPSI</u>) yang berjudul: Analisis Return Saham dan Risiko pada Investasi Saham Syariah dengan Model Markowitz dan Model Indeks Tunggal	
Dengan Hak Bebas	Royalti Non-ekslusif ini UPT Perpustakaan Perpustakaan UIN Sayyid Ali

Rahmatullah Tulungagung berhak menyimpan, alih media/format, mengelola dalam bentuk pangkalan data (*database*), merawat, dan mempublikasikan tugas akhir saya selama tetap mencantumkan nama saya sebagai penulis/pencipta dan sebagai Pemilik Hak Cipta.

Demikian pernyataan ini saya buat untuk dapat dipergunakan sebagaimana mestinya.

Tulungagung, 14 Januari 2023

Yang Menyatakan,

METERAL TEMPEL 941AKX193898062

February Wahyuning Wulan

NIM. 12406173074