

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMPUL DEPAN.....	i
HALAMAN JUDUL.....	ii
PERSETUJUAN PEMBIMBING.....	iii
PENGESAHAN	iv
PERNYATAAN KEASLIAN.....	v
MOTTO.....	vi
PERSEMBAHAN	vii
PRAKATA.....	viii
DAFTAR ISI	x
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GAMBAR	xv
DAFTAR LAMPIRAN	xvi
ABSTRAK	xvii
ABSTRACT.....	xviii
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Identifikasi dan Pembatasan Masalah.....	15
C. Rumusan masalah	17
D. Tujuan Penelitian	18
E. Kegunaan Penelitian	19
F. Penegasan Istilah	20
1. Return	20
2. Risiko.....	21
3. Reksa Dana syariah.....	21
4. Index Sharpe	22
5. Index Treynor.....	22
6. Jensen Alpa	22
G. Sistematika Penulisan.....	23
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	25
A. Konsep Dasar Reksa Dana Syariah	25

1. Definisi dan karakteristik reksa dana syariah	25
B. Return dan Risiko dalam Investasi Reksa Dana syariah	27
1. Definisi dan jenis-jenis return investasi.....	27
2. Faktor yang Memengaruhi Return dalam Investasi.....	29
3. Definisi dan jenis-jenis risiko dalam investasi	30
C. Indeks Sharpe, Treynor dan Jensen	31
1. Fungsi Indeks Sharpe.....	31
2. Fungsi Indeks Treynor	32
3. Fungsi Indeks Jensen alpa	33
D. Penelitian Terdahulu	34
E. Kerangka Konseptual.....	43
BAB III METODE PENELITIAN.....	46
A. Rancangan Penelitian	46
1. Pendekatan Penelitian.....	46
2. Jenis Penelitian	47
B. Populasi dan Sampel.....	48
1. Populasi	48
2. Sampel	49
C. Instrumen Penelitian	52
1. Perhitungan Return and risiko	53
2. Perhitungan Indeks Sharpe	54
3. Perhitungan Treynor	55
4. Perhitungan Indeks Jensen.....	55
D. Sumber dan Teknik Pengumpulan Data	55
E. Prosedur Penelitian	56
F. Analisis Data.....	56
BAB IV HASIL PENELITIAN	59
A. Analisis Return dan Risiko Reksa Dana Syariah (2020–2023).....	59
1. Return Reksa Dana Syariah Pendapatan tetap 2020-2023	59
2. Return Reksa Dana Syariah Saham 2020-2023.....	62
3. Return Reksa Dana Syariah Campuran 2020-2023	66
4. Standar Deviasi Reksa Dana Syariah Pendapatan tetap 2020-2023 ..	72

5. Standar Deviasi Reksa Dana Syariah Saham 2020-2023	76
6. Standar Deviasi Reksa Dana Syariah Campuran 2020-2023	79
7. Perbandingan karakteristik return dan risiko antar jenis reksa dana syariah berdasarkan hasil analisis selama periode 2020–2023	82
8. Interpretasi terkait fluktuasi pasar, kebijakan ekonomi, dan faktor risiko makro	84
B. Analisis Kinerja Reksa Dana Syariah Berdasarkan Indeks Sharpe	86
C. Analisis Kinerja Reksa Dana Syariah Berdasarkan Indeks Treynor.....	98
D. Analisis Kinerja Reksa Dana Syariah Berdasarkan Indeks Jensen Alpha	115
BAB V PEMBAHASAN	153
A. Analisis Return dan Risiko Reksa Dana Syariah Tahun 2020–2023	153
B. Evaluasi Kinerja Reksa Dana Syariah Menggunakan Indeks Sharpe ...	156
C. Evaluasi Kinerja Reksa Dana Syariah Menggunakan Indeks Treynor..	157
D. Evaluasi Kinerja Reksa Dana Syariah Menggunakan Indeks Treynor..	160
BAB VI: PENUTUP	163
A. Kesimpulan.....	163
B. Saran	144
DAFTAR PUSTAKA	166
LAMPIRAN	170