

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMPUL LUAR	i
HALAMAN JUDUL.....	ii
PERSETUJUAN PEMBIMBING.....	iii
LEMBAR PENGESAHAN	iv
PERNYATAAN KEASLIAN TULISAN.....	v
PERNYATAAN PUBLIKASI.....	vi
MOTTO.....	vii
PERSEMBAHAN.....	viii
KATA PENGANTAR.....	ix
DAFTAR ISI	xi
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
DAFTAR GRAFIK	xv
DAFTAR LAMPIRAN	xvi
ABSTRAK	xvii
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Identifikasi Masalah dan Batasan Penelitian	16
C. Rumusan Masalah	18
D. Tujuan Penelitian.....	18
E. Kegunaan Penelitian.....	19
F. Ruang Lingkup Penelitian.....	20
G. Penegasan Variabel.....	21
H. Sistematika Pembahasan	23
BAB II LANDASAN TEORI	26
A. Pasar Modal Syariah	26
B. Investasi.....	39
C. Reksa Dana Syariah	46
D. Portofolio Optimal	59
E. Nilai Aktiva Bersih (NAB).....	61

F. Tolok Ukur (<i>Benchmark</i>) Reksa Dana	63
G. Evaluasi Kinerja Reksa Dana	64
H. Kajian Penelitian Terdahulu	68
I. Kerangka Penelitian	75
BAB III METODE PENELITIAN	76
A. Pendekatan dan Jenis Penelitian	76
B. Variabel dan Skala Pengukuran	77
C. Populasi dan Sampel Penelitian	78
D. Teknik Pengumpulan Data	81
E. Analisis Data	81
BAB IV HASIL PENELITIAN	91
A. Deskripsi Data	91
B. Temuan Penelitian	94
BAB V PEMBAHASAN	111
A. Kinerja Reksa Dana Syariah Menggunakan Metode <i>Sharpe</i> Tahun 2020 – 2024	111
B. Kinerja Reksa Dana Syariah Menggunakan Metode <i>Treynor</i> Tahun 2020 – 2024	114
C. Kinerja Reksa Dana Syariah Menggunakan Metode <i>Jensen</i> Tahun 2020 – 2024	118
D. Kesesuaian antara Jenis Reksa Dana Syariah dan Metode Evaluasi Kinerja Berdasarkan Tipe Investor	121
BAB VI PENUTUP	124
A. Kesimpulan	124
B. Implikasi Penelitian	126
C. Saran	127
DAFTAR RUJUKAN	129
LAMPIRAN	137

DAFTAR TABEL

Tabel 3.1 Daftar Sampel Reksa Dana Syariah	80
Tabel 4.1 Gambaran Umum Sampel Reksa Dana Syariah.....	93
Tabel 4.2 Hasil Perhitungan <i>Realized Return</i> dan <i>Expected Return</i>	94
Tabel 4.3 Hasil Perhitungan <i>Return Market</i> dan <i>Expected Return Market</i>	98
Tabel 4.4 Hasil Perhitungan Aktiva Bebas Resiko (RBR).....	100
Tabel 4.5 Hasil Perhitungan Standar Deviasi, Varian, <i>Beta</i> , <i>Alpha</i> , Varian dari Kesalahan Residu, Titik Pembatas dan ERB	102
Tabel 4.6 Daftar Reksa Dana Syariah Berportofolio Optimal	106
Tabel 4.7 Hasil Perhitungan Indeks <i>Sharpe</i> , <i>Treynor</i> dan <i>Jensen</i>	107

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Penelitian	75
--------------------------------------	----

DAFTAR GRAFIK

Grafik 1.1 NAB Reksa Dana Konvensional Tahun 2020 – 2024 (Rp. Miliar) ...	7
Grafik 1.2 NAB Reksa dana Syariah tahun 2020 – 2024 (Rp. Miliar)	9

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Biodata Penulis	138
Lampiran 2 Kartu Kendali	139