

## DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL .....	i
HALAMAN PENGESAHAN .....	ii
PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI .....	iii
BIODATA PENULIS .....	vi
MOTTO DAN PERSEMBAHAN .....	v
KATA PENGANTAR .....	vi
DAFTAR ISI .....	vii
DAFTAR TABEL .....	xi
DAFTAR GAMBAR .....	xii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiii
ABSTRAK .....	xiv
ABSTRACT .....	xv
<b>BAB I PENDAHULUAN</b>	
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Perumusan Masalah .....	4
1.3 Tujuan Penelitian .....	5
1.4 Manfaat Penelitian .....	5
<b>BAB II KAJIAN PUSTAKA</b>	
2.1 Landasan Teori.....	6
2.1.1 Investasi.....	6
2.1.2 Return.....	7

2.1.3	Risiko .....	8
2.1.4	Pasar Modal.....	9
2.1.4.1	Pemilihan Saham yang Memenuhi Prinsip-prinsip Syariah .....	10
2.1.4.2	Indeks Harga Saham .....	11
2.1.5	Portofolio Optimal.....	13
2.1.5.1	<i>Single Index Model</i> Pembentukan Portofolio Optimal .....	14
2.1.5.2	<i>Constant Correlation Model</i> Pembentukan Portofolio Optimal .....	16
2.2	Model Empirik .....	18
2.3	Model Pemikiran.....	19
 <b>BAB III METODE PENELITIAN</b>		
3.1	Jenis Penelitian .....	20
3.2	Sumber Data dan Metode Pengumpulan Data .....	21
3.2.1	Sumber Data.....	21
3.2.2	Metode Pengumpulan Data.....	21
3.3	Populasi dan Sampel .....	23
3.4	Variabel dan Indikator.....	24
3.5	Teknik Analisis Data.....	31
3.5.1	Memilih saham yang akan diikuti dalam portofolio	32
3.5.2	Uji Statistik ( <i>Paired Sample T-Test</i> ).....	33
 <b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN</b>		

4.1	Analisis Deskriptif .....	35
4.1.1	Deskriptif Sampel .....	35
4.1.2	Deskriptif Saham Individual .....	36
4.1.3	Deskriptif Return Pasar dan Return Bebas Risiko ...	38
4.2	Analisis Portofolio .....	39
4.2.1	Single Index Model .....	39
4.2.2	Constant Correlation.....	46
4.3	Penentuan Portofolio Optimal.....	54
4.3.1	Hasil Pengujian Hipotesis .....	57
4.3.1.1	Hasil Uji Hipotesis untuk return portofolio.....	57
4.3.1.2	Hasil Uji Hipotesis untuk risiko portofolio.....	59

## BAB VI PENUTUP

5.1	Kesimpulan .....	62
5.2	Keterbatasan.....	65
5.3	Saran.....	65

## DAFTAR PUSTAKA

## LAMPIRAN