

DAFTAR ISI

ABSTRAK	i
KATA PENGANTAR	iii
DAFTAR ISI.....	v
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
 BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	6
1.3 Tujuan dan Manfaat	6
1.4 Sistematika Penulisan	7
 BAB II TELAAH PUSTAKA	
2.1 Pasar modal	9
2.1.1 Pengertian Pasar Modal.....	9
2.1.2 Tujuan dan Instrumen Pasar modal.....	9
2.1.3 Fungsi Pasar Modal.....	10
2.2 Investasi	11
2.2.1 Pengertian Investasi	11
2.2.2 Proses Keputusan Investasi	11
2.2.3 Dasar Keputusan Investasi	14
2.2.4 Tujuan Investasi	15

2.3 Saham.....	17
2.3.1 Pengertian Saham.....	17
2.3.2 Jenis-jenis Saham.....	17
2.3.3 Penilaian Saham.....	18
2.3.4 Proses Terbentuknya Harga Saham	20
2.4 Portofolio	21
2.4.1 Pengertian Portofolio	21
2.4.2 Portofolio Optimal	22
2.4.7 Portofolio Optimal Berdasarkan Model Indeks Tunggal.....	25
2.5 Indeks Saham Syariah Indonesia (ISSI).....	27
2.6 Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Harga Saham.....	27
2.6 Penelitian Terdahulu	30
2.7 Kerangka pemikiran	32
BAB III METODE PENELITIAN	
3.1 Lokasi/objek Penelitian.....	33
3.2 Operasional Variabel.....	33
3.3 Populasi dan Sampel	35
3.4 Jenis dan Sumber Data	37
3.5 Teknik Pengumpulan Data.....	37
3.6 Analisis Data	38
BAB IV GAMBARAN UMUM LOKASI PENELITIAN	
4.1 Sejarah Singkat Bursa Efek Indonesia	41

4.2 Sejarah Singkat Indeks Saham Syariah Indonesia	48
4.3 Sejarah Singkat Perusahaan Sampel	49
BAB V HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
5.1 Analisis Deskriptif Variabel Penelitian.....	75
5.1.1 Perhitungan Return (R_i) Saham Individual	75
5.1.2 Penghitungan Return Pasar	76
5.1.3 Perhitungan Return Ekspektasi	78
5.1.3 Perhitungan Risiko.....	79
5.1.4 Menentukan Nilai ERB	81
5.1.5 Perhitungan Nilai A_i, B_i, A_j, B_j, C_i	82
5.1.6 Menentukan Saham-saham yang Masuk Kandidat Portofolio Optimal	83
5.1.7 Penentuan Kombinasi Portofolio	84
5.1.8 Menentukan Proporsi Dana.....	84
5.1.9 Perhitungan Return Ekspektasi Portofolio.....	85
5.1.10 Perhitungan Tingkat Risiko Portofolio	85
5.1.11 Menentukan Portofolio Optimal	86
5.2 Pembahasan.....	87
BAB VI KESIMPULAN DAN SARAN	
6.1 Kesimpulan	91
6.2 Saran.....	92

DAFTAR PUSTAKA 94



Dokumen ini adalah Arsip Milik :
Perpustakaan Universitas Islam Riau

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Data Harga Saham Syariah Perusahaan Sektor Industri	
Barang Konsumsi	5
Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu	30
Tabel 3.1 Operasional Variabel.....	33
Tabel 3.2 Daftar Perusahaan Sampel Penelitian	36
Tabel 5.1 Return IHSG Periode 2016-2017	77
Tabel 5.2 Return Ekspektasi	78
Tabel 5.3 Risiko, Daftar Beta (β) dan risiko unik ($\sigma_{\epsilon i}^2$).....	79
Tabel 5.4 Nilai <i>ERB</i> Perusahaan.....	81
Tabel 5.5 Hasil Perhitungan A_i, B_i, A_j, B_j , dan C_i	82
Tabel 5.6 Saham Kandidat Portofolio Optimal.....	83
Tabel 5.7 Kombinasi Portofolio Saham Optimal.....	84
Tabel 5.8 Return Ekspektasi Portofolio ($E(R_p)$) Kombinasi Saham.....	85
Tabel 5.9 Tingkat Risiko Portofolio (σ_p^2) Kombinasi Saham.....	85
Tabel 5.10 Portofolio Optimal	86

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran..... 32



DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Data harian historis saham syariah perusahaan industri barang konsumsi yang terdaftar di Indeks Saham Syariah (ISS) periode (1 Desember 2016 - 30 November 2017) dan IHSG

Lampiran 1 Data *Return* harian saham syariah perusahaan industri barang konsumsi yang terdaftar di Indeks Saham Syariah (ISS) periode (1 Desember 2016 - 30 November 2017)

Lampiran 3 Hasil perhitungan model indeks tunggal

Lampiran 4 Ekspektasi Portofolio ($E(R_p)$) Kombinasi Saham dan Tingkat Risiko Portofolio (σ_p^2) kombinasi saham