

DAFTAR ISI

Lembar Persembahan	<i>i</i>
Lembar Pengesahan	<i>ii</i>
Lembar Pernyataan Orisinalitas	<i>iii</i>
Lembar Persetujuan Publikasi	<i>iv</i>
Riwayat Hidup Penulis	<i>v</i>
Abstrak	<i>vi</i>
Kata Pengantar	<i>vii</i>
Daftar Isi	<i>x</i>
Daftar Gambar	<i>xii</i>
Daftar Tabel	<i>xiii</i>
BAB I. PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	4
1.2. Rumusan Masalah	4
1.3. Batasan Masalah	4
1.4. Tujuan Penelitian	4
1.5. Manfaat Penelitian	4
BAB II. TINJAUAN PUSTAKA	6
2.1. Indeks Saham Syariah Indonesia (ISSI)	6
2.2. Investasi	6
2.3. Saham	7
2.4. Portofolio	7
2.5. Model Indeks Tunggal	7
BAB III. METODOLOGI PENELITIAN	16
3.1. Tempat dan Waktu Penelitian	16
3.2. Jenis Penelitian	16
3.3. Metode Penelitian	16
3.4. Prosedur Penelitian	16
3.5. Diagram Alir Penelitian	19
BAB IV. HASIL DAN PEMBAHASAN	20
4.1. Hasil Penelitian	20
4.1.1. Deskripsi Data	20
4.1.2. Analisis Data	21
4.2. Pembahasan	40
BAB V. Penutup	44
5.1. Kesimpulan	44
5.2. Saran	44
DAFTAR PUSTAKA	45
Lampiran A. Tabel Data Harga Saham	47
Lampiran B. Tabel Data IHSG	58

Lampiran C.	Tabel Data Suku Bunga Bebas Risiko	59
Lampiran D.	Hasil Olah Data Menggunakan Model Indeks Tunggal	60
Lampiran E.	Surat Persetujuan Dosen Pembimbing.....	71
Lampiran F.	Surat Izin Melaksanakan Penelitian.....	72
Lampiran G.	Surat Persetujuan Penelitian	73
Lampiran H.	Surat Telah Menyelesaikan Penelitian.....	74



THE
Character Building
 UNIVERSITY

DAFTAR GAMBAR

Gambar 3.1. Diagram Alir Penelitian 19



DAFTAR TABEL

Tabel 4.1	Data Harga Saham	20
Tabel 4.2	Data IHSG	21
Tabel 4.3	Data BI rate	21
Tabel 4.4	Hasil Perhitungan <i>Return</i> Saham	23
Tabel 4.5	Hasil Perhitungan Ekspektasi <i>Return</i> Saham	24
Tabel 4.6	Tabel Hasil Perhitungan Risiko saham individual	25
Tabel 4.7	Hasil Menghitung <i>Return</i> Pasar	27
Tabel 4.8	Hasil Perhitungan kovarians Antara <i>Return</i> saham dan <i>Return</i> pasar.....	30
Tabel 4.9	Hasil Perhitungan Beta Saham.....	31
Tabel 4.10	Hasil Perhitungan Alpha Saham	32
Tabel 4.11	Hasil Perhitungan Total Resiko Setiap Saham.....	34
Tabel 4.12	Hasil Perhitungan <i>Excess Return to Beta</i> (ERB)	35
Tabel 4.13	Hasil Perhitungan <i>Nilai Cutt Of Point</i> (Ci).....	37
Tabel 4.14	Hasil Perhitungan Proporsi.....	38
Tabel 4.15	Hasil Perhitungan Ekspektasi <i>Return</i> Portofolio	39
Tabel 4.16	Hasil Perhitungan Risiko Portofolio.....	40

