

DAFTAR ISI

<i>ABSTRACT</i>	i
ABSTRAK	ii
PENGESAHAN	iii
PERNYATAAN	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR SINGKATAN	xii
DATAR LAMPIRAN	xiii
BAB I. PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	4
1.3. Maksud dan Tujuan	4
1.4. Pembatasan Masalah	4
1.5. Manfaat	5
1.6. Sistematika Penulisan	6
BAB II. DISKRIPSI PERUSAHAAN	7
2.1. Sejarah Pasar Modal Indonesia	7
2.2. Indeks Pasar Modal	12

2.2.1.	Indeks Harga Saham Gabungan	12
2.2.2.	Indeks LQ-45	13
2.2.3.	<i>Jakarta Islamic Index</i>	14
2.3.	Surat Berharga Yang Diperdagangkan di BEI	16
 BAB III. KAJIAN PUSTAKA		18
3.1.	Kajian Pustaka	18
3.1.1.	Investasi	18
3.1.2.	Saham	20
3.1.3.	Analisa Saham	21
3.1.4.	<i>Return</i> dan Risiko	25
3.1.5.	Teori Portofolio	27
3.1.6.	Pemilihan Portofolio	32
3.1.7.	Model Indeks Tunggal	36
3.1.8.	Analisis Kinerja Portofolio	37
3.1.8.1.	Indeks Sharpe	39
3.1.8.2.	Indeks Treynor	41
3.1.8.3.	Indeks Jensen	43
3.2.	Kerangka Pemikiran	45
 BAB IV. METODE PENELITIAN		47
4.1.	Objek Penelitian	47
4.2.	Metode Penelitian	47
4.2.1.	Teknik Pengumpulan Data	47

4.2.2. Metode Analisis	47
4.2.3. Tahapan Pengolahan Data	60
BAB V. HASIL DAN ANALISIS	62
5.1. Pembentukan Portofolio Optimal Index LQ-45	62
5.2. Pembentukan Portofolio Optimal <i>Jakarta Islamic Index</i>	68
5.3. Analisis Kinerja Portofolio Optimal	76
BAB VI. KESIMPULAN DAN REKOMENDASI	80
6.1 Pembentukan Portofolio Optimal	80
6.2 Analisis Kinerja Portofolio Optimal	81
6.3 Rekomendasi	81
DAFTAR PUSTAKA	83
LAMPIRAN	85
RIWAYAT HIDUP	278