

DAFTAR ISI

LEMBAR PERNYATAAN KARYA SENDIRI.....	i
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	ii
ABSTRAK	iii
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Rumusan Masalah.....	11
C. Tujuan dan Kontribusi Penelitian	12
1. Tujuan Penelitian	12
2. Kontribusi Penelitian	12
BAB II KAJIAN PUSTAKA DAN RERANGKA PEMIKIRAN	14
A. Kajian Pustaka	14
1. Investasi	14
2. Saham.....	22
3. Tingkat Pengembalian (Return) Investasi Saham.....	28
4. Risiko (Risk) Investasi Saham	30
5. Capital Asset Pricing Model (CAPM)	30

B. Penelitian Terdahulu	37
C. Rerangka Pemikiran.....	44
BAB III. METODE PENELITIAN	47
A. Waktu dan Tempat Penelitian	47
B. Desain Penelitian	47
C. Definisi dan Operasionalisasi Variabel.....	48
D. Populasi dan Sampel Penelitian	50
E. Teknik Pengumpulan Data.....	52
F. Metode Analisis	53
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	56
A. Gambaran Umum.....	56
1 Jakarta Islamic Index	57
2 Astra Argo Lestari Tb	57
3 Adaro Energy Tbk.....	57
4 AKR Corporindo Tbk	57
5 Aneka Tambang (Persero) Tbk.....	58
6 Astra International Tbk	58
7 Alam Sutera Realty Tbk.....	59
8 Bumi Serpong Damai Tbk	59
9 Indofood CBP Sukses Makmur Tbk	59
10 Vale Indonesia Tbk	60
11 Indofood Sukses Makmur Tbk.....	60
12 Indocement Tungal Prakasa Tbk.....	60

13	Indo Tambangraya Megah Tbk.....	61
14	Jasa Marga (Persero) Tbk	61
15	Kalbe Farma Tbk	62
16	Lippo Karawaci Tbk	62
17	PP London Sumatra Indonesia Tbk	62
18	Media Nusantara Citra Tbk.....	63
19	Matahari Putra Prima Tbk.....	63
20	Perusahaan Gas Negara (Persero) Tbk.....	65
21	Tambang Batubara Bukit Asam (Persero) Tbk.....	64
22	PP (Persero) Tbk	65
23	Pakuwon Jati Tbk.....	64
24	Semen Indonesia (Persero) Tbk	65
25	Summarecon Agung Tbk	65
26	Sawit Sumbermas Sarana Tbk	65
27	Telekomunikasi Indonesia (Persero) Tbk	66
28	United Tractors Tbk.....	66
29	Unilever Indonesia Tbk.....	66
30	Wijaya Karya (Persero) Tbk	67
31	Waskita Karya (Persero) Tbk.....	67
B.	Perhitungan Data.....	68
1.	Perhitungan Return Saham	68
2.	Perhitungan Return Market.....	70
3.	Perhitungan Beta Saham	73

4. Perhitungan Risk Free Rate	75
5. Perhitungan Capital Asset Pricing Model.....	76
BAB V SIMPULAN DAN SARAN.....	80
A. Simpulan	80
B. Saran.....	81
DAFTAR PUSTAKA.....	83
LAMPIRAN.....	85



UNIVERSITAS
MERCU BUANA