

DAFTAR ISI

ABSTRAK	i
ABSTRACT.....	ii
KATA PENGANTAR	iii
UCAPAN TERIMA KASIH	iv
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GRAFIK	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
Latar Belakang Penelitian	1
1.1 Identifikasi Masalah	8
1.2 Maksud dan Tujuan Penelitian	8
1.3 Kegunaan Penelitian	9
1.4 Metode Penelitian	10
1.5 Lokasi dan Waktu Penelitian	10
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	11
2.1 Pasar Modal	11
2.1.1 Pengertian Pasar Modal	11
2.1.2 Instrument Pasar Modal	11
2.1.3 Manfaat Pasar Modal	12
2.1.4 Fungsi Pasar Modal	13
2.1.5 Mekanisme Perdagangan di Pasar Modal	14
2.2 Investasi	16
2.2.1 Pengertian Investasi	16

2.2.2	Tipe – tipe Investasi	16
2.2.3	Tujuan Investasi	17
2.2.4	Dasar Keputusan Investasi	18
2.2.5	Proses Keputusan Investasi	19
2.3	Portofolio Optimal	21
2.3.1	Pengertian Portofolio	21
2.3.2	Tujuan Portofolio	23
2.4	Model Indeks Tunggal	23
2.4.1	Pengertian Model Indeks Tunggal	23
2.4.2	Langkah – langkah Pembentukan Portofolio Optimal	25
2.5	Capital Asset Pricing Model	32
2.5.1	Pengertian Capital Asset Pricing Model	32
2.5.2	Langkah – langkah Pembentukan Portofolio Optimal	35
2.6	Saham – saham yang termasuk dalam Jakarta Islamic Index	36
2.7	Penelitian Terdahulu	37
2.8	Kerangka Pemikiran	
2.9	Hipotesa Penelitian	43
	BAB III OBJEK DAN METODE PENELITIAN	44
3.1.	Objek Penelitian	44
3.1.1.	Sejarah Bursa Efek Indonesia	44
3.1.2.	Peran dan Kewajiban Bursa Efek Indonesia	49
3.1.3.	Sistem Perdagangan di Bursa Efek Indonesia.....	49
3.1.4.	Jakarta Islamic Index (JII)	50
3.1.5.	Gambaran Umum Perusahaan	51
3.2.	Metode Penelitian.....	59
3.2.1.	Jenis Penelitian	59
3.2.2.	Jenis dan Sumber Data	60

3.2.3. Teknik Pengumpulan Data	61
3.2.4. Operasionalisasi Variabel Penelitian	61
3.2.5. Populasi dan Sampel Penelitian	63
3.2.6. Teknik Pengolahan dan Analisis Data	63
3.2.6.1. Metode Analisis	63
3.2.6.2. Pengujian Hipotesis	72
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	74
4.1. Pembentukan Portofolio Optimal Saham Menggunakan Singel IndexModel dan Capital Asset Pricing pada Jakarta Islamic Index	74
4.1.1. Pembentukan Portofolio Optimal Saham Menggunakan Singel Index Model	
4.1.2. Pembentukan Portofolio Optimal Saham Menggunakan Capital AssetPricing Model	80
4.2. Analisis Perbandingan Pembentukan Portofolio Optimal Saham antara SingelIndex Model dengan Capital Asset Pricing Model	84
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	86
5.1. Kesimpulan	86
5.2. Saran 87

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

RIWAYAT HIDUP