

DAFTAR ISI

	Halaman
DAFTAR ISI	ii
DAFTAR TABEL	iv
DAFTAR GAMBAR	v
DAFTAR RUMUS	vi
DAFTAR LAMPIRAN	vii
I. PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	10
1.3 Tujuan Penelitian	10
1.4 Manfaat Penelitian	10
II. TINJAUAN PUSTAKA	12
2.1 Pasar Modal	12
2.1.1 Instrumen Pasar Modal	13
2.2 Investasi	16
2.2.1 Pengertian Investasi	16
2.2.2 Tipe-tipe Investasi	18
2.2.3 Tujuan investasi	19
2.2.4 Proses Investasi	20
2.3 Teori Portofolio	23
2.3.1 Konsep <i>Return</i> dan risiko	24
2.3.2 <i>Return</i> portofolio	25
2.3.3 Risiko Portofolio	26
2.4 Portofolio Efisien	28
2.5 Portofolio Optimal	28
2.6 <i>Metode Simple Criteria for Optimal Portfolio Selection</i> (SCOPS)	29
2.6.1 Model Indeks Tunggal dan Pembentukan Portofolio Optimal	31
2.6.2 Beta	33
2.6.3 Standar Deviasi	38
2.6.4 Varian dan Kovarian	39
2.6.5 ERB	40
2.6.6 <i>Cut off Point</i>	41
2.7 <i>Jakarta Islamic Index</i>	42

2.8 Tinjauan Penelitian Terdahulu	43
2.9 Kerangka Pemikiran	44
III. METODE PENELITIAN	48
3.1 Jenis Penelitian	48
3.2 Populasi dan Sampel	48
3.3 Jenis dan Sumber Data	50
3.4 Teknik Pengumpulan Data	51
3.5 Definisi Konseptual	51
3.6 Definisi Operasional	52
3.7 Teknik Analisis Data	54
IV. HASIL DAN PEMBAHASAN	62
4.1 Gambaran Umum Objek Penelitian	62
4.1.1 PT Astra Agro Lestari Tbk (AALI)	63
4.1.2 PT Aneka Tambang (Persero) Tbk (ANTM)	63
4.1.3 PT Astra International Tbk (ASII)	64
4.1.4 PT Alam Sutera Realty Tbk (ASRI)	65
4.1.5 PT International Nickel Indonesia Tbk (INCO)	66
4.1.6 PT Indocement Tunggul Prakarsa Tbk (INTP)	67
4.1.7 PT Indo Tambangraya Megah Tbk (ITMG)	68
4.1.8 PT Kalbe Farma Tbk (KLBF)	69
4.1.9 PT Lippo Karawaci Tbk (LPKR)	70
4.1.10 PT PP Lonton Sumatra Indonesia Tbk (LSIP)	71
4.1.11 PT Tambang Batubara Bukit Asam Tbk (PTBA)	72
4.1.12 PT Semen Indonesia (Persero) Tbk (SMGR)	73
4.1.13 PT Telekomunikasi Indonesia (Prsero) Tbk (TLKM) ..	74
4.1.14 PT United Tractors Tbk (UNTR)	75
4.1.15 PT Unilever Indonesia Tbk (UNVR)	76
4.2 Hasil Penelitian	77
4.2.1 Analisis Model Indeks Tunggal	77
4.2.2 Analisis Penentuan Kombinasi Portofolio Optimal	84
4.2.3 Analisis <i>Return</i> Ekspektasi Portofolio dan Risiko Portofolio	87
4.3 Pembahasan	91
V. KESIMPULAN DAN SARAN	109
5.1 Kesimpulan	109
5.2 Saran	110

DAFTAR PUSTAKA
LAMPIRAN