

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN	i
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS	ii
KATA PENGANTAR.....	iii
DAFTAR ISI.....	v
DAFTAR TABEL	vii
DAFTAR GAMBAR.....	viii
DAFTAR LAMPIRAN	ix
INTISARI	x
ABSTRACT	xi
BAB I.....	1
PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Pertanyaan Penelitian	6
1.4 Tujuan Penelitian	6
1.5 Manfaat Penelitian	7
1.6 Lingkup Penelitian	7
1.7 Sistematika Penelitian	8
BAB II	10
TINJAUAN PUSTAKA DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS.....	10
2.1 Landasan Teori.....	10
2.1.1 Investasi	10
2.1.2 Risk, Return, dan Portofolio	11
2.1.3 Socially Responsible Investment (SRI)	15
2.1.4 Teori Stakeholder	17
2.1.5 Evaluasi Kinerja Portofolio.....	18
2.2 Kajian Penelitian Terdahulu.....	19
2.3 Pengembangan Hipotesis	21
2.4 Kerangka Pemikiran.....	22
BAB III.....	24
METODOLOGI PENELITIAN	24
3.1 Data dan Sampel Penelitian	24
3.1.1 Data dan Sampel	24
3.1.2 Metode Pengambilan Sampel.....	24

3.2 Definisi Operasional dan Instrumen Penelitian	27
3.2.1 Membentuk Portofolio Optimal	27
3.2.2 Evaluasi Kinerja Portofolio Saham	30
3.3 Metode Analisis Data	32
BAB IV	33
HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	33
4.1 Pembentukan Portofolio Optimal	33
4.1.1 Pembentukan Portofolio Efisien SRI Kehati	33
4.1.2 Pembentukan Portofolio Efisien LQ 45	36
4.2 Perbandingan Kinerja Portofolio SRI Kehati dan LQ 45	41
4.2.1 Perbandingan Kinerja Portofolio dengan Rasio Sharpe	42
4.2.2 Perbandingan Kinerja Portofolio dengan Rasio Treynor	43
4.2.3 Perbandingan Kinerja Portofolio dengan Rasio Jensen Alpha	44
BAB V	46
KESIMPULAN DAN SARAN	46
5.1 Kesimpulan	46
5.2 Keterbatasan Penelitian	47
5.3 Saran	48
5.4 Implikasi	48
DAFTAR PUSTAKA	50
LAMPIRAN	53