

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN	i
PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS TESIS	ii
KATA PENGANTAR	iii
DAFTAR ISI	iv
DAFTAR TABEL	vi
DAFTAR GAMBAR	vii
DAFTAR LAMPIRAN	viii
ABSTRAK	ix
ABSTRACT	x
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	8
1.3 Pertanyaan Penelitian.....	10
1.4 Tujuan Penelitian	10
1.5 Manfaat Penelitian	11
1.6 Lingkup Penelitian.....	12
1.7 Sistematika Penulisan	12
BAB II LANDASAN TEORI	14
2.1 Landasan Teori	14
2.1.1 Investasi Syariah.....	14
2.1.2 Teori Diversifikasi dan Teori Portofolio Modern.....	15
2.1.3 Teori <i>Capital Asset Pricing Model</i> (CAPM).....	16
2.1.4 Rasio Sharpe	17
2.1.5 Rasio Treynor	18
2.2 Kajian Penelitian Terdahulu	20
2.3 Kerangka Penelitian.....	22
BAB III METODE PENELITIAN	24
3.1 Desain Penelitian	24
3.2 Metode Pengumpulan Data.....	25

3.3	Instrumen Penelitian	26
3.4	Metode Analisis Data	26
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN		30
4.1	Deskripsi Data	30
4.1.1	Informasi Data Instrumen Investasi	30
4.1.2	Klasifikasi Saham berdasarkan Risiko dan Nilai Beta	31
4.1.3	Analisis Deskriptif	34
4.1.4	Pembentukan Alternatif Portofolio	44
4.1.5	Analisis Portofolio Optimal	51
4.2	Pembahasan	60
4.2.1	Pembentukan Portofolio Optimal BPKH dengan Menggunakan Klasifikasi Risiko dan Beta pada Instrumen Saham Syariah	60
4.2.2	Simulasi Portofolio dan Perbandingan dengan Kinerja BPKH	66
BAB V KESIMPULAN		79
5.1	Simpulan	79
5.2	Implikasi	81
5.2.1	Implikasi Teoritis	81
5.2.2	Implikasi Praktis	82
5.3	Keterbatasan	82
5.4	Saran	83
5.4.1	BPKH	83
5.4.2	Penelitian Selanjutnya	83
5.4.3	Regulator	84
DAFTAR PUSTAKA		85