

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL .....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN .....	iii
KATA PENGANTAR .....	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR GAMBAR.....	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
INTISARI .....	xii
ABSTRACT.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 Pertanyaan Penelitian .....	4
1.3 Tujuan Penelitian.....	5
1.4 Manfaat Penelitian.....	5
BAB II TINJAUAN PUSTAKA .....	6
2.1 Investasi .....	6
2.2 Saham Syariah .....	7
2.3 Portofolio .....	9
2.3.1 Portofolio Optimal .....	10
2.3.2 Optimalisasi Portofolio dengan Model Indeks Tunggal .....	12
2.4 Data Envelopment Analysis (DEA).....	13
2.5 Evaluasi Kinerja Portofolio .....	15
2.6 Penelitian Terdahulu .....	16
2.7 Pengembangan Hipotesis.....	17
BAB III METODE PENELITIAN .....	20
1.1 Data dan Sampel.....	20
1.1.1 Data .....	20
1.1.2 Sampel.....	20
1.2 Definisi Operasional dan Pengukuran Variabel .....	21
1.3 Metode Analisis Data.....	30

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN .....	33
4.1 Pembentukan Portofolio Saham Optimal.....	33
4.1.1 Portofolio Optimal Indeks JII .....	34
4.1.2 Portofolio Optimal Indeks Kompas100 .....	40
4.2 Analisis Kinerja Portofolio Optimal.....	46
4.2.1 Indeks Sharpe .....	46
4.2.2 Indeks Treynor .....	51
4.2.3 Indeks Jensen .....	55
4.3 Uji Hipotesis.....	59
4.4 Diskusi.....	65
BAB V PENUTUP .....	67
5.1 Kesimpulan .....	67
5.2 Keterbatasan Penelitian .....	67
5.3 Saran.....	68
5.4 Implikasi.....	68
DAFTAR PUSTAKA .....	69