

DAFTAR ISI

ABSTRAKSI.....	i
CURRICULUM VITAE.....	v
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR.....	xv
DAFTAR LAMPIRAN	xvi
BAB I.....	1
PENDAHULUAN.....	1
1.1 LATAR BELAKANG	1
1.2 RUMUSAN MASALAH.....	2
1.3 TUJUAN PENELITIAN.....	3
1.4 MANFAAT PENELITIAN.....	3
BAB II	4
TINJAUAN PUSTAKA	4
2.1 TINJAUAN TEORITIS	4
2.1.1 KINERJA.....	4
2.1.2 INVESTASI DALAM SAHAM	4
2.1.3 INDEKS HARGA SAHAM	5
2.1.4 JAKARTA ISLAMIC INDEKS (JII)	6
2.1.5 INDEKS LQ-45	7
2.1.6 RETURN, RISIKO, DAN PORTOFOLIO	8
2.1.7 INDEKS SHARPE (<i>Reward To Variability</i>)	9
2.2 PENELITIAN TERDAHULU	10
2.3 KERANGKA PEMIKIRAN	14

2.4 HIPOTESIS PENELITIAN	14
BAB III	15
METODE PENELITIAN.....	15
3.1 JENIS PENELITIAN.....	15
3.2 POPULASI DAN SAMPEL	15
3.5.1 POPULASI	15
3.5.2 SAMPEL.....	16
3.3 SUMBER DATA.....	18
3.4 PERIODE PENGAMATAN DAN PENELITIAN.....	18
3.5 VARIABEL PENELITIAN DAN OPERASIONAL VARIABEL.....	19
3.5.1 RATA-RATA RETURN INDEKS SAHAM (R _i)	19
3.5.2 RATA-RATA RETURN SAHAM BEBAS RISIKO (R _f)	19
3.5.3 STANDAR DEVIASI RETURN SAHAM (σ_p)	19
3.6 METODE ANALISIS DATA.....	20
3.6.1 MENGHITUNG <i>RETURN AKTUAL INDEKS</i>	20
3.6.2 MENGHITUNG <i>RETURN PASAR</i>	21
3.6.3 MENGHITUNG RISIKO INDEKS.....	21
3.6.4 MENGHITUNG KOEFISIEN BETA (β).....	21
3.6.5 UJI NORMALITAS.....	22
3.6.6 PENGUJIAN KINERJA INDEKS	22
3.6.7 PENGUJIAN HIPOTESIS DENGAN INDEPENDENT SAMPLE T-TEST .	23
BAB IV	23
HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	23
4.1 PENYAJIAN DATA	23
4.1.1 GAMBARAN OBJEK PENELITIAN.....	23
4.1.2 <i>RETURN AKTUAL INDEKS</i> (R _i)	24
4.1.3 <i>RETURN PASAR</i> (R _m)	35
4.1.4 RISIKO INDEKS (VARIANS DAN STANDAR DEVIASI <i>RETURN SAHAM</i> / σ).....	36
4.1.5 BETA SAHAM (β).....	41

4.1.6 UJI NORMALITAS	44
4.1.7 PERHITUNGAN INDEKS SHARPE (REWARD TO VARIABILITY)	46
4.1.8 UJI HIPOTESIS INDEPENDENT SAMPLE T-TEST	53
4.2 INTERPRETASI HASIL PENELITIAN	54
BAB V.....	56
KESIMPULAN DAN SARAN	56
5.1 KESIMPULAN.....	56
5.2 SARAN	58
DAFTAR PUSTAKA	58
LAMPIRAN 1 PERHITUNGAN RETURN SAHAM INDEKS LQ45 TAHUN 2014.....	65
LAMPIRAN 2 PERHITUNGAN RETURN SAHAM INDEKS LQ45 TAHUN 2015.....	68
LAMPIRAN 3 PERHITUNGAN RETURN SAHAM INDEKS LQ45 TAHUN 2016.....	71
LAMPIRAN 4 PERHITUNGAN RETURN SAHAM JAKARTA ISLAMIC INDEX (JII) TAHUN 2014.....	75
LAMPIRAN 5 PERHITUNGAN RETURN SAHAM JAKARTA ISLAMIC INDEX (JII) TAHUN 2015	78
LAMPIRAN 6 PERHITUNGAN RETURN SAHAM JAKARTA ISLAMIC INDEX (JII) TAHUN 2016.....	81
LAMPIRAN 7 PERHITUNGAN INDEKS SHARPE (REWARD TO VARIABILITY) INDEKS LQ45 TAHUN 2014	84
LAMPIRAN 8 PERHITUNGAN INDEKS SHARPE (REWARD TO VARIABILITY) INDEKS LQ45 TAHUN 2015	85
LAMPIRAN 9 PERHITUNGAN INDEKS SHARPE (REWARD TO VARIABILITY) INDEKS LQ45 TAHUN 2016	86

LAMPIRAN 10 PERHITUNGAN INDEKS SHARPE (<i>Reward To Variability</i>) JAKARTA ISLAMIC INDEX (JII) TAHUN 2014	87
LAMPIRAN 11 PERHITUNGAN INDEKS SHARPE (<i>Reward To Variability</i>) JAKARTA ISLAMIC INDEX (JII) TAHUN 2015	88
LAMPIRAN 12 PERHITUNGAN INDEKS SHARPE (<i>Reward To Variability</i>) JAKARTA ISLAMIC INDEX (JII) TAHUN 2016	89