

DAFTAR ISI

Halaman Judul.....	i
Lembar Pengesahan	ii
Lembar Riset	iii
Lembar Pernyataan Orisinalitas	iv
Lembar Riwayat Hidup	v
Ucapan Terima Kasih.....	vi
Abstrak	viii
Kata Pengantar	x
Daftar Isi.....	xi
Daftar Tabel	xiii
Daftar Gambar.....	xiv
Daftar Lampiran.....	xv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang Penelitian	1
1.2. Rumusan Masalah	3
1.3. Tujuan Penelitian.....	3
1.4. Manfaat Penelitian.....	4
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	5
2.1. Tinjauan Teoritis	5
2.1.1. Investasi dan Saham	5
2.1.2. Indeks Harga Saham.....	6
2.1.2.1. <i>Indeks Harga Saham Gabungan</i>	7
2.1.2.2. <i>Indeks Sektoral</i>	7
2.1.2.3. <i>Indeks LQ-45</i>	8
2.1.2.4. <i>Jakarta Islamic Index (JII)</i>	9
2.1.2.5. <i>Indeks KOMPAS 100</i>	9
2.1.2.6. <i>Indeks BISNIS 27</i>	10
2.1.2.7. <i>Indeks PEFINDO 25</i>	11
2.1.2.8. <i>Indeks SRI-KEHATI</i>	11
2.1.2.9. <i>Indeks Saham Papan Utama</i>	12
2.1.2.10. <i>Indeks Saham Papan Pengembangan</i>	12

2.1.2.11. <i>Indeks Individual</i>	13
2.1.3. <i>Return</i> dan Resiko	13
2.1.4. Kinerja Indeks Saham dan Pengukurannya.....	15
2.2. Penelitian Terdahulu	17
2.3. Kerangka Pemikiran.....	20
BAB III METODE PENELITIAN.....	21
3.1. Jenis Penelitian.....	21
3.2. Populasi dan Sampel	21
3.3. Metode Pengumpulan Data	21
3.4. Metode Analisis Data	22
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	24
4.1. Gambaran Objek Penelitian.....	24
4.2. Analisis Data	24
4.2.1. Analisis Kinerja Indeks Saham dengan Metode Sharpe.....	24
4.2.2. Analisis Kinerja Indeks Saham dengan Metode Treynor	26
4.2.3. Analisis Kinerja Indeks Saham dengan Metode Jensen	28
4.3. Pemeringkatan Indeks Saham	29
4.3.1. Pemeringkatan Indeks Saham Metode Sharpe	29
4.3.2. Pemeringkatan Indeks Saham Metode Treynor.....	30
4.3.3. Pemeringkatan Indeks Saham Metode Jensen.....	31
4.4. Pembahasan.....	32
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	36
5.1. Kesimpulan.....	36
5.2. Kontribusi Penelitian.....	37
5.3. Keterbatasan Penelitian	37
5.4. Saran.....	37
DAFTAR PUSTAKA	38
LAMPIRAN	39