

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
PERSETUJUAN PEMBIMBING SKRIPSI	ii
PENGESAHAN MUNAQOSYAH.....	iii
PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI	iv
ABSTRAK.....	v
MOTTO	vi
PERSEMBAHAN.....	vii
KATA PENGATAR	viii
DAFTAR ISI.....	xi
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii
 BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Rumusan Masalah.....	10
C. Tujuan Penelitian	10
D. Manfaat Penelitian	10
E. Sistematika Penulisan	11
 BAB II KAJIAN PUSTAKA	
A. Kajian Pustaka Terkait Judul	
1. Investasi	12
a. Pengertian investasi	12
b. Tujuan Investasi.....	15
c. Proses Investasi	15
2. Portofolio.....	18
a. Portofolio Efisien	18
b. Portofolio Optimal	20
1) Model Markowitz	20
2) Model Indeks Tunggal.....	24
3. Return Portofolio	26
4. Risiko Portofolio.....	27
5. Saham	29
6. Saham Syariah	30
7. Consumer Goods Industry dan ISSI ...	32
B. Penelitian Terdahulu	33
C. Kerangka Berfikir	43

BAB III : METODE PENELITIAN

A. Jenis dan Pendekatan	45
B. Populasi dan Sampel Penelitian	45
C. Definisi Operasional Variabel.....	48
D. Teknik Pengumpulan Data.....	52
E. Teknik Analisis Data	53

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

A. Hasil Penelitian	
1. Gambaran Obyek Penelitian	54
2. Analisis Data Penelitian.....	56
a. Prosedur Pembentukan Portofolio Optimal Menggunakan Model Indeks Tunggal.....	57
b. Alokasi Dana Portofolio Optimal.....	67
c. Besarnya Expected Return dan Risiko Portofolio Optimal.....	68
B. Pembahasan	
1. Pembentukan Portofolio Optimal Menggunakan Model Indeks Tunggal	71
2. Proporsi Dana Portofolio Optimal Saham	73
3. Return dan Risiko Portofolio	74

BAB V : PENUTUPAN

A. Simpulan.....	75
B. Saran-saran	75

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN-LAMPIRAN

DAFTAR RIWAYAT HIDUP

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Perkembangan Return Indeks Consumer Periode 2017-2019	8
Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu	38
Tabel 3.1 Daftar Saham Consumer Goods Industry	46
Tabel 4.1 Daftar Anggota Sampel Penelitian	55
Tabel 4.2 Volume Perdagangan Anggota Sampel	56
Tabel 4.3 Data Consumer Goods Industry	57
Tabel 4.4 Data Tingkat Suku Bunga Syarian (BI Rate) Pada periode 2017-2019	58
Tabel 4.5 Expected Return, Standar Deviation, dan Variance Saham Individual	59
Tabel 4.6 Expected Return, Standar Deviation, Variance Consumer	61
Tabel 4.7 Data Tingkat Suku Bunga Syarian (BI Rate) Pada periode 2017-2019	61
Tabel 4.8 Beta, Alpha, Variance Error Residual, dan Excess Return to Beta Saham	56
Tabel 4.9 Menghitung Cut-off Rate	65
Tabel 4.10 Menghitung Cut-off Point	66
Tabel 4.11 Alokasi Dana Masing-masing Saham	68
Tabel 4.12 Expected Return Portofolio Optimal	69
Tabel 4.13 Risiko Portofolio Optimal	70

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Portofolio Efisien.....	19
Gambar 2.2 Portofolio Optimal Berdasarkan Preferensi Masing-Masing Investor	22
Gambar 2.3 Kerangka Berfikir Pembentukan Portofolio Optimal	44

