

DAFTAR ISI

Halaman Judul.....	i
Persetujuan Skripsi.....	ii
Pernyataan Orisinalitas Skripsi.....	iii
Pengesahan Kelulusan.....	iv
Motto dan Persembahan.....	v
Kata Pengantar.....	vi
Daftar Isi.....	viii
Daftar Tabel.....	xii
Daftar Gambar.....	xiii
Daftar Lampiran.....	xiv
Abstrak.....	xv
Bab I.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	11
1.3 Tujuan Penelitian.....	12
1.4 Manfaat Penelitian.....	12
1.5 Sistematika Penulisan.....	13
Bab II.....	16
2.1 Landasan Teori.....	16

2.1.1 Pengertian Investasi	16
2.1.1.1 Pengertian Investasi Saham Syariah	17
2.1.1.2 Emas Sebagai Instrumen Investasi.....	19
2.2 Teori Portofolio Modern	20
2.2.1 <i>Return</i> Investasi.....	22
2.2.2 Risiko Investasi	23
2.2.3 <i>Return</i> dan Risiko Investasi	24
2.2.4 Pengaruh JII Terhadap <i>Return</i> dan Risiko Saham Syariah	25
2.2.5 Pengaruh IHSG Terhadap <i>Return</i> dan Risiko Emas	26
2.3 Analisis <i>Return</i> Dan Risiko Menurut CAPM	26
2.3.1 Konsep Dasar <i>Capital Asset Pricing Model</i> (CAPM).....	28
2.3.2 Persamaan Dasar <i>Capital Asset Pricing Model</i> (CAPM)	28
2.3.3 Hubungan <i>Capital Asset Pricing Model</i> (CAPM) Dengan Regresi.....	29
2.4 Penelitian Terdahulu	31
2.5 Interpretasi Ekonomi Koefisien Dalam Model CAPM.....	37
2.5.1 Pengertian <i>Abnormal Return</i>	38
2.5.2 <i>Abnormal Return</i> Dalam Konteks CAPM	38
2.5.3 <i>Abnormal Return</i> Saham Syariah dan Emas.....	39
2.6 Kerangka Pemikiran.....	40
2.7 Hipotesis Penelitian.....	42
Bab III	43
3.1 Jenis Dan Pendekatan Penelitian.....	43
3.3 Kriteria Sampel Penelitian	43

3.4 Definisi Operasional Variabel.....	44
3.5 Jenis Dan Sumber Data Penelitian	49
3.6 Teknik Pengumpulan Data	50
3.7 Metode Analisis Data.....	50
3.7.1 Analisis Statistik Deskriptif	51
3.7.2 Analisis Statistik	51
3.6.1.1 Deteksi Asumsi Klasik.....	52
3.6.1.2 Deteksi - T (Deteksi Parsial)	58
3.6.1.3 Deteksi - F (Deteksi Simultan).....	59
Bab IV	61
4.1 Gambaran Objek Penelitian	61
4.2 Analisis Data.....	61
4.3 Hasil Deteksi Normalitas	64
4.4 Hasil Deteksi Multikolinearitas	65
4.5 Hasil Deteksi Homoskedastisitas dan Heteroskedastisitas.....	66
4.6 Hasil Deteksi Autokorelasi	67
4.7 Hasil Deteksi -T (Deteksi Parsial)	68
4.8 Hasil Deteksi - F (Deteksi Simultan)	70
4.9 Intrepretasi Hasil.....	71
4.9.1 Hasil Intrepretasi Deteksi - F (Deteksi Simultan).....	71
4.9.2 Intrepretasi Deteksi - T.....	72

Bab V	75
5.1 Kesimpulan	75
5.2 Keterbatasan	76
5.3 Saran.....	76
Daftar Pustaka.....	78



FEB UNDIP