

DAFTAR ISI

JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN I	ii
HALAMAN PENGESAHAN II	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRAK	v
<i>ABSTRACT</i>	vi
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR	x
LAMPIRAN	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	6
1.3 Batasan Masalah	6
1.4 Tujuan Penelitian	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	8
2.1 Saham	8
2.2 Investasi	8
2.3 <i>Return</i>	9
2.3.1 <i>Expected Return Saham</i>	10
2.3.2 <i>Return Portofolio</i>	10
2.4 Risiko	11
2.4.1 Risiko Sistematis	11
2.4.2 Risiko Tidak Sistematis	12
2.5 <i>Jakarta Islamic Index (JII)</i>	12
2.6 Portofolio	13
2.7 <i>Capital Asset Pricing Model (CAPM)</i>	15
2.8 <i>Mean Variance Efficient Portfolio (MVEP)</i>	17
2.9 Distribusi Normal	21
2.10 Uji Asumsi Normalitas Multivariat	22

2.11	<i>Value at Risk</i> (VaR).....	24
2.12	VaR dengan Simulasi Monte Carlo.....	25
2.13	GUI R.....	27
BAB III METODE PENELITIAN.....		29
3.1	Jenis dan Sumber Data	29
3.2	Variabel Penelitian	29
3.3	Tahapan Analisis Data	29
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		33
4.1	Menghitung <i>return</i> tiap saham	33
4.2	Menghitung <i>return</i> dan <i>expected return</i> pasar	33
4.3	Menghitung <i>return</i> bebas risiko	34
4.4	Menghitung beta dari masing-masing saham.....	34
4.5	Menghitung <i>expected return</i> saham	35
4.6	Seleksi saham dengan CAPM	37
4.7	Uji Normalitas	37
4.8	Menghitung proporsi saham dengan MVEP.....	40
4.9	Penghitungan Return Portofolio Saham.....	43
4.10	Menghitung VaR portofolio saham dengan simulasi Monte Carlo ...	44
4.11	<i>Graphical User Interface</i> (GUI) R.....	46
BAB V KESIMPULAN.....		58
DAFTAR PUSTAKA		59
LAMPIRAN.....		62