

DAFTAR ISI

HALAMAN PERSETUJUAN	i
PEDOMAN TRANSLITERASI ARAB-LATIN.....	ii
DAFTAR ISI.....	xvi
DAFTAR GAMBAR	xvii
DAFTAR TABEL.....	xviii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xix
BAB 1 PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang.....	1
1.2. Rumusan Masalah.....	8
1.3. Tujuan Penelitian	8
1.4. Manfaat Penelitian	9
1.5. Sistematika Skripsi	10
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA	12
2.1. Landasan Teori.....	12
2.1.1. Investasi	12
2.1.2. Pasar Modal	14
2.1.3. Pasar Modal Syariah	16
2.1.4. Saham Syariah	19
2.1.5. Risiko	20
2.1.6. <i>Return</i>	21
2.1.7. Beta	23
2.1.8. Memprediksi Return Saham	24
2.2. Penelitian Terdahulu	34
2.3. Hipotesis.....	36
2.4. Model Analisis	38
2.5. Kerangka Berpikir	40
BAB 3 METODE PENELITIAN.....	41
3.1. Pendekatan Penelitian	41

3.2. Identifikasi Variabel.....	41
3.3. Definisi Operasional Variabel.....	42
3.3.1. Variabel Dependen	42
3.3.2. Variabel Independen	44
3.4. Jenis dan Sumber Data	44
3.5. Prosedur Pengumpulan Data	45
3.6. Populasi dan Sampel	46
3.7. Teknik Analisis	47
3.7.1. Menghitung Expected Return	47
3.7.2. Mean Absolute Deviation (MAD)	48
3.7.3. Uji Normalitas.....	47
3.7.4. Uji Beda	48
BAB 4 PEMBAHASAN.....	48
4.1. Gambaran Umum Subjek Penelitian.....	48
4.2. Deskripsi Hasil Penelitian.....	50
4.2.1. Capital Asset Pricing Model	50
4.2.2. Arbitrage Pricing Theory (APT).....	57
4.2.3. Perbandingan Akurasi Model Capital Asset Pricing dan Arbitrage Pricing Theory (APT)	65
4.3. Analisis Hasil Penelitian	50
4.3.1. Uji Normalitas.....	67
4.3.1. Hasil Uji Hipotesis.....	68
4.4. Pembahasan.....	69
BAB 5 SIMPULAN DAN SARAN.....	76
5.1. Simpulan	76
5.1. Saran.....	76
DAFTAR PUSTAKA	78