

Daftar Isi

<i>Lembar Pengesahan</i>	<i>i</i>
<i>PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS TESIS</i>	<i>ii</i>
<i>KATA PENGANTAR</i>	<i>iv</i>
<i>Daftar Isi</i>	<i>vi</i>
<i>Daftar Gambar</i>	<i>viii</i>
<i>Daftar Tabel</i>	<i>ix</i>
<i>Daftar Lampiran</i>	<i>xi</i>
<i>ABSTRAK</i>	<i>xii</i>
<i>ABSTRACT</i>	<i>xiii</i>
<i>BAB I PENDAHULUAN</i>	<i>1</i>
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah.....	10
1.3 Pertanyaan Penelitian	13
1.4 Tujuan Penelitian	13
1.5 Manfaat Penelitian	13
1.6 Lingkup Penelitian	15
1.7 Sistematika Penulisan	16
<i>BAB II LANDASAN TEORI</i>	<i>18</i>
2.1 Investasi.....	18
2.2 Saham Syariah.....	19
2.3 Teori Portofolio	22
2.4 Penilaian Kinerja Portofolio	35
2.5 Hipotesis	40
2.6 Penelitian Terdahulu.....	41
2.7 Kerangka Penelitian.....	46
<i>BAB III METODA PENELITIAN</i>	<i>47</i>
3.1 Desain Penelitian	47
3.2 Metoda Pengumpulan Data.....	47

3.3 Instrumen Penelitian	49
3.4 Metoda Analisis Data	50
<i>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN</i>	51
4.1 Analisis Data	51
4.1.1 Expected Return dan Varians Bulanan Individual Saham, Pasar, dan BI7DRR	51
4.1.2 Beta, Alpha dan Varians Residual Individual Saham.....	58
4.1.3 Membentuk Portofolio Optimal	62
4.1.4 <i>Return</i> dan Varians Portofolio	67
4.1.5 Sharpe Ratio, Treynor Ratio dan Jensen Alpha Portofolio Optimal.....	74
4.2 Uji Normalitas	78
4.3 Uji Beda Mann-Whitney	81
4.1.1 Menguji Hipotesa ke-1: Kinerja portofolio optimal saham manufaktur syariah lebih baik dari konvensional	82
4.1.2 Menguji Hipotesa ke-2: Kinerja portofolio optimal saham manufaktur syariah lebih baik dari konvensional pada masa normal.....	83
4.1.3 Menguji Hipotesa ke-3: Kinerja portofolio optimal saham manufaktur syariah lebih baik dari konvensional pada masa krisis pandemi.....	84
4.4 Pembahasan	85
<i>BAB V SIMPULAN</i>	87
5.1 Kesimpulan	87
5.2 Keterbatasan	89
5.3 Saran	90
<i>DAFTAR PUSTAKA</i>	92
<i>LAMPIRAN</i>	96