

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR GAMBAR	ix
DAFTAR LAMPIRAN.....	x
ABSTRAK	xi
ABSTRACT.....	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Perumusan Masalah	6
1.3. Pertanyaan Penelitian.....	7
1.4. Tujuan Penelitian	7
1.5. Manfaat Penelitian	7
1.6. Lingkup Penelitian	8
1.7. Sistematika Penulisan	8
BAB II LANDASAN TEORI	10
2.1. Teori Investasi.....	10
2.2. Pasar Modal	11
2.3. Prinsip Syariah di Pasar Modal.....	11
2.4. Indek Saham Syariah Indonesia (ISSI).....	12
2.5. Teori Portofolio.....	12
2.6. <i>Single Index Model</i>	14
2.7. Teori Kinerja Portofolio.....	14
2.7.1. Indeks <i>Sharpe</i>	14
2.7.2. Indeks <i>Treynor</i>	15
2.7.3. Indeks <i>Jensen Alpha</i>	15

2.8. Penelitian Terdahulu	16
2.9. Pengembangan Hipotesis	17
BAB III METODE PENELITIAN.....	19
3.1. Sampel Penelitian.....	19
3.2. Data dan Metode Pengambilan Data.....	19
3.3. Instrumen Penelitian	20
3.4. Metoda Analisis Data.....	30
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	33
4.1. Pembentukan portofolio.....	33
4.2. Deskriptif Data.....	35
4.3. Kinerja Portofolio	39
4.4. Uji Beda Dua Kinerja Portofolio	42
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	46
5.1. Kesimpulan	46
5.2. Implikasi	47
5.3. Keterbatasan.....	48
5.4. Saran	48
DAFTAR PUSTAKA	50

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1 Komposisi Portofolio Saham Syariah dan Non Syariah per Periode Pengamatan.....	34
Tabel 4.2 Komposisi Sektor Portofolio Saham Syariah dan Non Syariah.....	35
Tabel 4.3 Statistik Deskriptif Portofolio Syariah dan Non Syariah Tahun 2011- 2020	36
Tabel 4.4 Statistik Deskriptif Portofolio Syariah dan Non Syariah Tahun 2018..	37
Tabel 4.5 Statistik Deskriptif Portofolio Syariah dan Non Syariah Tahun 2020..	38
Tabel 4.6 Hasil Pengujian Kinerja Portofolio optimal.....	39
Tabel 4.7 Hasil Pengujian Kinerja Portofolio <i>Equal weighted</i>	41
Tabel 4.8 Hasil Uji Normalitas dan Homogenitas	42
Tabel 4.9 Perbandingan Indeks Kinerja Portofolio Periode 2011-2020	43
Tabel 4.10 Perbandingan Indeks Kinerja Portofolio Periode 2018	44
Tabel 4.11 Perbandingan Indeks Kinerja Portofolio Periode 2020	45

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Risiko Portofolio, Risiko Sistematis dan Risiko Tidak Sistematis ...	13
Gambar 3 1 Kerangka Penelitian	32

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Komposisi Saham Setiap Portofolio yang dibentuk.....	54
Lampiran 2 Uji Normalitas	57
Lampiran 3 Uji Homogenitas.....	59
Lampiran 4 Hasil Uji Beda	62