

Daftar Isi

Halaman Judul.....	i
Halaman Pengesahan.....	ii
Pernyataan Keaslian Karya Tulis.....	iii
Kata Pengantar.....	iv
Daftar Isi.....	v
Daftar Tabel.....	vii
Daftar Gambar.....	viii
Daftar Persamaan.....	ix
Intisari	x
<i>Abstract</i>	xi
BAB I. PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	4
1.3 Tujuan Penelitian.....	4
1.4 Manfaat Penelitian.....	5
1.5 Batasan Penelitian.....	5
1.6 Sistematika Penulisan.....	6
BAB II. TINJAUAN PUSTAKA	
2.1 Studi Empiris sebelumnya.....	7
2.2 Teori Investasi.....	9
2.2.1 <i>Capital Asset Pricing Model</i> (CAPM).....	11
2.2.1 <i>Arbitrage Pricing Theory</i> (APT).....	12
2.2.3 <i>Size</i> dan <i>Book to Market</i> (B/M) Effect.....	13
2.3 Investasi Syariah (<i>Sharia Investment</i>).....	14
2.4 Pasar Modal Syariah.....	15
2.5 Perbandingan Kinerja Portofolio.....	19
2.6 <i>Stochastic Dominance</i>	21
2.7 Hipotesis.....	26

BAB III. METODE PENELITIAN

3.1 Data.....	28
3.2 Periode Penelitian.....	28
3.3 <i>Screening</i> Sampel Data Penelitian.....	30
3.4 Prosedur Penelitian Dengan <i>Stochastic Dominance</i>	31
3.5 Alat Analisa.....	33
3.6 Spesifikasi Model.....	33
3.7 Model Uji SD <i>Davidson Duclos</i> (DD).....	34

BAB IV. HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1 Pembentukan Portofolio.....	36
4.2 Statistik Deskriptif.....	39
4.3 Uji Parametrik.....	48
4.4 Uji <i>Stochastic Dominance</i>	53

BAB V. KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan.....	66
5.2 Saran.....	69

Daftar Pustaka

Lampiran