

DAFTAR ISI

HALAAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERNYATAAN	ii
HALAMAN PERSETUJUAN	Kesalahan! Bookmark tidak ditentukan.
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
MOTTO	v
KATA PENGANTAR.....	vi
ABSTRAKSI	vii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang	1
B. Rumusan Masalah	9
C. Tujuan Penelitian	10
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	11
A. Landasan Teori.....	11
B. Penelitian terdahulu.....	37
C. Kerangka Berpikir	40
D. Hipotesis.....	41

BAB III METODE PENELITIAN.....	42
A. Jenis Penelitian.....	42
B. Obyek dan Waktu Penelitian.....	42
C. Periode Amatan.....	43
D. Jenis dan Sumber Data Penelitian.....	43
E. Prosedur Pengambilan Data.....	43
F. Klasifikasi Variabel Penelitian.....	44
G. Definisi Operasional Variabel.....	45
H. Teknik Analisis Data.....	47
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	53
A. Deskripsi Hasil Penelitian.....	53
B. Hasil analisis	57
C. Pembahasan.....	63
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	72
A. Kesimpulan	72
B. Saran.....	73
DAFTAR PUSTAKA.....	74
LAMPIRAN	76

DAFTAR TABEL

4.1 Deskriptif statistik <i>return</i> dan indeks Sharpe indeks saham konvensional SRI-KEHATI.....	54
4.2 Deskriptif statistik <i>return</i> dan indeks Sharpe indeks saham syariah JII.....	56
4.3 Hasil rata-rata <i>Return</i> (2015-2019)	57
4.4 Hasil rata-rata indeks Sharpe (2015-2019)	59
4.5 Hasil Uji normalitas <i>Kolmogorov Smirnov</i>	60
4.6 Hasil Uji normalitas <i>Kolmogorov Smirnov</i> setelah <i>treatment</i> data	61
4.7 Hasil uji beda <i>Independent Sample T-test</i> indeks saham konvensional SRI-KEHATI dan indeks saham syariah JII	62

DAFTAR GAMBAR

1.1 Grafik Pergerakan Indeks Harga Saham Syariah JII dan Indeks Saham Konvensional SRI-KEHATI serta IHSG	5
2.1 Tahapan Seleksi Indeks SRI-KEHATI	22
2.2 Kerangka Berfikir	39
4.1 Grafik <i>Return</i> SRI-KEHATI dan JII tahun 2015-2019	63
4.2 Diagram komposisi bobot kapitalisasi pasar indeks saham konvensional SRI-KEHATI dan indeks saham syariah JII per Desember 2019.....	64
4.3 Grafik indeks Sharpe SRI-KEHATI dan JII tahun 2015-2019	67

DAFTAR LAMPIRAN

LAMPIRAN 1 Data Perusahaan dalam Indeks Saham Konvensional SRI-KEHATI.....	77
LAMPIRAN 2 Data Perusahaan dalam Indeks Saham Syariah JII.....	84
LAMPIRAN 3 Data <i>Return</i> dan Indeks Sharpe Indeks Saham Konvensional SRI-KEHATI dan Indeks Saham Syariah JII.....	92
LAMPIRAN 4 Hasil Deskriptif Analisis.....	96
LAMPIRAN 5 Hasil Uji Noramlitas Indeks Saham Konvensional SRI-KEHATI dan Indeks Saham Syariah JII.....	98
LAMPIRAN 6 Hasil Uji Beda <i>Independent Sample T-test Return</i> Selama Lima Tahun (2015-2019).....	101
LAMPIRAN 7 Hasil Uji Beda <i>Independent Sample T-test</i> Indeks Sharpe Selama Lima Tahun (2015-2019).....	103