

DAFTAR ISI

LEMBAR PERSETUJUAN	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
SURAT PERNYATAAN BEBAS PLAGIARISME	iii
ABSTRAK	iv
LEMBAR PERSEMBAHAN	vi
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR	xiv
DAFTAR LAMPIRAN	xv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang Penelitian.....	1
B. Identifikasi Masalah	10
C. Batasan Masalah	11
D. Rumusan Masalah	12
E. Tujuan Penelitian	12
F. Manfaat Penelitian.....	12
G. Jadwal Penelitian.....	13
H. Sistematika Penulisan Skripsi.....	14
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	16
A. Konsep dan Teori.....	16
1. Manajemen.....	16
2. Manajemen Keuangan	21
3. Pasar Modal	26
4. Pasar Modal Syariah	36
5. Investasi	38
6. <i>Return</i> dan <i>Risk</i>	42
7. Rasio <i>Sharpe</i>	46
8. Teori Portofolio Modern	47

9. Efficient Market Hypothesis	47
10. Signaling Theory	48
B. Kajian Penelitian Terdahulu	49
C. Kerangka Berpikir	55
D. Hipotesis	59
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	61
A. Metode dan Pendekatan	61
B. Jenis dan Sumber Data Penelitian	61
1. Jenis Data	61
2. Sumber Data	62
C. Populasi dan Sampel	62
1. Populasi	62
2. Sampel	66
D. Operasional Variabel	68
1. <i>Return</i>	68
2. <i>Risk</i>	68
3. Rasio <i>Sharpe</i>	69
E. Teknik Pengumpulan Data	70
1. Studi kepustakaan	70
2. Pengumpulan dokumen perusahaan	71
3. Riset internet	71
F. Teknik Analisis Data	71
1. Analisis Deskriptif	71
2. Uji Normalitas	74
3. Uji Homogenitas	74
4. Uji Beda Independent Sample T-Test	75
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	77
A. Gambaran Umum	77
1. Jakarta Islamic Index	77
2. IDX Quality30	80
B. Analisis Data	83
1. Analisis <i>Return</i>	83

2. Analisis <i>Risk</i>	90
3. Analisis Rasio <i>Sharpe</i>	98
C. Pengujian dan Hasil Analisis	108
1. Statistik Deskriptif	108
2. Uji Normalitas	110
3. Uji Homogenitas	112
4. Uji Beda <i>Independent Sample T-Test</i>	115
D. Pembahasan	120
1. Perbandingan <i>Return</i> Saham Syariah dengan Saham Konvensional	120
2. Perbandingan <i>Risk</i> Saham Syariah dengan Saham Konvensional	124
3. Perbandingan Rasio <i>Sharpe</i> Saham Syariah dengan Saham Konvensional	131
BAB V PENUTUP	137
A. Kesimpulan	137
B. Keterbatasan Penelitian	138
C. Saran	139
DAFTAR PUSTAKA	141
LAMPIRAN	148