

## DAFTAR ISI

Halaman

HALAMAN JUDUL .....	i
HALAMAN PENGESAHAN .....	ii
HALAMAN PENGESAHAN UJIAN .....	iii
PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI .....	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN .....	v
ABSTRAKSI.....	vi
ABSTRACT.....	vii
KATA PENGANTAR .....	viii
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GAMBAR.....	xiv
DAFTAR LAMPIRAN .....	xv

### BAB I PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang Masalah .....	1
1.2 Perumusan Masalah.....	3
1.3 Tujuan Penelitian.....	3
1.4 Manfaat Penelitian.....	4
1.4.1 Bagi Praktisi.....	4
1.4.2 Bagi Akademisi.....	5

### BAB II TINJAUAN PUSTAKA

2.1 Landasan Teori .....	6
2.1.2 Teori Investasi .....	6
2.1.2 Teori Portofolio .....	7
2.1.3 Pasar Modal .....	10

2.1.4 Saham .....	12
2.1.5 Indeks Harga Saham .....	14
2.1.6 Kinerja Saham Konvensional dan Syariah .....	15
2.2 Penelitian Terdahulu .....	17
2.3 Kerangka Pemikiran Teoritis dan Pengembangan Hipotesis ...	18
2.3.1 Perbedaan Kinerja Saham Syariah Dengan Kinerja Saham Di Tinjau Dari Return Saham .....	18
2.3.2 Perbedaan Kinerja Saham Syariah Dengan Kinerja Saham Di Tinjau Dari Resiko Saham .....	19
2.3.3 Perbedaan Kinerja Saham Syariah Dengan Kinerja Saham Di Tinjau Dari Volatilitas Pasar .....	20
 <b>BAB III METODE PENELITIAN</b>	
3.1 Jenis Penelitian .....	22
3.2 Populasi dan Sampel .....	22
3.3 Jenis dan Sumber Data .....	23
3.4 Metode Pengumpulan Data .....	23
3.5 Definisi Oeprasional dan Pengukuran Variabel .....	24
3.5.1 Return Saham .....	24
3.5.2 Resiko Saham.....	24
3.5.3 Volatilitas Pasar .....	27
3.6 Metode Analisis .....	28
 <b>BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN</b>	
4.1 Statistik Deskriptif .....	30
4.2 Normalitas Data .....	34
4.3 Pengujian Hipotesis .....	35

4.4.1	Pengujian Hipotesis Perbedaan Return Saham Konvensional dan Return Saham Syariah .....	35
4.4.2	Pengujian Hipotesis Perbedaan Resiko Saham Konvensional dan Resiko Saham Syariah .....	36
4.4.3	Pengujian Hipotesis Perbedaan Volatilitas Saham Konvensional dan Volatilitas Saham Syariah .....	37
4.5	Pembahasan.....	38
4.5.1	Pengujian Hipotesis Perbedaan Return Saham Konvensional dan Return Saham Syariah .....	38
4.5.2	Pengujian Hipotesis Perbedaan Resiko Saham Konvensional dan Resiko Saham Syariah .....	38
4.5.3	Pengujian Hipotesis Perbedaan Volatilitas Saham Konvensional dan Volatilitas Saham Syariah .....	39
 BAB V PENUTUP		
5.1	Simpulan .....	41
5.2	Saran .....	42
5.3	Keterbatasan .....	43
 DAFTAR PUSTAKA .....		44
 LAMPIRAN		

## DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu .....	17
Tabel 3.1 Distribusi Pengambilan Sampel.....	23
Tabel 4.1 Nama Sampel Kategori Saham Konvensional.....	30
Tabel 4.2 Nama Sampel Kategori Saham Syariah. ....	31
Tabel 4.3 Statistik Deskriptif Saham Syariah.....	32
Tabel 4.4 Statistik Deskriptif Saham Konvensional.....	33
Tabel 4.5 Normalitas Saham.....	34
Tabel 4.6 Hasil Uji Beda Return Saham Kinerja Saham Konvensional dan Return Saham Saham Syariah.....	35
Tabel 4.7 Hasil Uji Beda Resiko Saham Kinerja Saham Konvensional dan Resiko Saham Saham Syariah.....	36
Tabel 4.8 Hasil Uji Beda Volatilitas Saham Kinerja Saham Konvensional dan Volatilitas Saham Saham Syariah.....	37

## DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 2.1 Kerangka Penelitian .....	21

## **DAFTAR LAMPIRAN**

- Lampiran 1. Contoh data stok price close market
- Lampiran 2. Perhitungan Variabel Return Saham Konvensional 2010-2012
- Lampiran 3. Perhitungan Variabel Return Saham Syariah 2010-2012
- Lampiran 4. Perhitungan Variabel Resiko Saham Konvensional 2010-2012
- Lampiran 5. Perhitungan Variabel Resiko Saham Syariah 2010-2012
- Lampiran 6. Tabel Hasil Perhitungan Semua Variabel Saham Konvensional & Syariah 2010-2012
- Lampiran 7. Hasil Pengolahan Data Uji Normalitas Semua variabel Dengan SPSS 17.
- Lampiran 8. Hasil Pengolahan Data Uji Beda Masing-masing variabel Dengan SPSS 17.