

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERNYATAAN	ii
HALAMAN PERSETUJUAN PEMBIMBING	iii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN	v
HALAMAN MOTTO	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GRAFIK.....	xiv
PEDOMAN TRANSLITERASI.....	xv
ABSTRAK	xx
 BAB I : PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Fokus Penelitian.....	9
C. Rumusan Masalah.....	9
D. Tujuan Penelitian	9
E. Manfaat Penelitian	10
F. Sistematika Penulisan Tesis	11
 BAB II : LANDASAN TEORI	
A. Pasar Modal Syariah	13
B. Indeks Saham Syariah.....	18
C. Volume Perdagangan	28
D. <i>Earning Per Share</i>	32
1. Pengertian <i>Earning Per Share</i>	32
2. Perhitungan <i>Earning Per Share</i>	33
E. Return Saham.....	34

1. Pengertian Return Saham.....	34
2. Perhitungan Return Saham.....	35
3. Komponen Return Saham.....	36
F. Penelitian Terdahulu	37
G. Kerangka Berfikir	40
BAB III : METODE PENELITIAN	
A. Jenis dan Pendekatan Penelitian	45
B. Sumber Data.....	45
C. Populasi dan Sampel.....	46
D. Identifikasi Variabel Penelitian.....	47
E. Variabel Operasional Penelitian.....	48
F. Teknik Pengumpulan Data.....	50
G. Teknik Analisis Data.....	50
BAB IV : HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
A. Gambaran Objek Penelitian	57
B. Deskripsi Data Penelitian.....	83
1. Data Penelitian Indeks Saham Syariah	83
2. Data Penelitian Volume Perdagangan.....	85
3. Data Penelitian <i>Earning Per Share</i>	88
4. Data Penelitian Return Saham	90
C. Hasil Penelitian	92
D. Pembahasan Penelitian.....	106
1. Pengaruh Variabel Indeks Saham Syariah Terhadap Return saham	106
2. Pengaruh Volume Perdagangan Terhadap Return Saham.....	110
3. Pengaruh <i>Earning Per Share</i> Terhadap Return Saham.....	113
BAB V : PENUTUP	
A. Simpulan	116
B. Saran-saran.....	117

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN-LAMPIRAN

DAFTAR RIWAYAT PENDIDIKAN



DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 : Kerangka Pemikiran.....	39
--------------------------------------	----



DAFTAR TABEL

Tabel 3.1 : Variabel Operasional Penelitian.....	46
Tabel 4.1 : Indeks Saham Syariah.....	82
Tabel 4.2 : Volume Perdagangan.....	85
Tabel 4.3 : <i>Earning Per Share</i>	87
Tabel 4.4 : Return Saham.....	89
Tabel 4.5 : Deskriptif Statistik.....	92
Tabel 4.6 : Pendekatan Common Effect.....	93
Tabel 4.7 : Pendekatan Fixed Effect.....	95
Tabel 4.8 : Pendekatan Random Effect.....	97
Tabel 4.9 : Uji F Test (Chow Test).....	99
Tabel 4.10 : Uji <i>Hausman Test</i>	99
Tabel 4.11 : Pendekatan Fixed Effect.....	100
Tabel 4.12 : Hasil Uji Otokorelasi	102
Tabel 4.13 : Hasil Uji R^2	103
Tabel 4.14 : Hasil Uji T- Statistik	104
Tabel 4.15 : Hasil Uji F- Statistik	105

DAFTAR GRAFIK

Grafik 4.1 : Perkembangan Indeks Saham Syariah.....	84
Grafik 4.2 : Perkembangan Volume Perdagangan.....	86
Grafik 4.3 : Perkembangan <i>Earning Per Share</i>	88
Grafik 4.4 : Perkembangan Return Saham.....	91



PEDOMAN TRANSLITERASI

Ejaan dan tanda-tanda penulisan dalam terjemah tesis ini, hampir sama dengan yang dipakai oleh buku-buku lain yang sudah lama tersiar di kalangan masyarakat. Terdapat beberapa versi pada dasarnya mempunyai pola yang cukup banyak, berikut ini disajikan pola transliterasi arab latin berdasarkan keputusan bersama antara Menteri Agama dan Menteri Pendidikan dan Kebudayaan R.I. No. 158 Tahun 1987 dan No. 0543b/U/1987.

Konsonan

Huruf	Nama	Penulisan
ا	<i>Alif</i>	‘
ب	<i>Ba</i>	b
ت	<i>Ta</i>	t
ث	<i>Tsa</i>	<u>S</u>
ج	<i>Jim</i>	j
ح	<i>Ha</i>	<u>H</u>
خ	<i>Kha</i>	kh
د	<i>Dal</i>	d
ذ	<i>Zal</i>	<u>Z</u>
ر	<i>Ra</i>	R
ز	<i>Zai</i>	Z
س	<i>Sin</i>	S
ش	<i>Syin</i>	Sy
ص	<i>Sad</i>	Sh
ض	<i>Dlod</i>	dl
ط	<i>Tho</i>	th
ظ	<i>Zho</i>	zh
ع	<i>‘Ain</i>	‘
غ	<i>Gain</i>	gh
ف	<i>Fa</i>	r
ق	<i>Qaf</i>	q
ك	<i>Kaf</i>	k
ل	<i>Lam</i>	l
م	<i>Mim</i>	m
ن	<i>Nun</i>	n
و	<i>Waw</i>	w
ه	<i>Ha</i>	h
ء	<i>Hamzah</i>	‘
ي	<i>Ya</i>	y
ة	<i>Ta (marbutoh)</i>	<u>I</u>

Contoh :

كتب : Kataba

ذكر : Zukira (Pola I atau II) dan seterusnya

Vokal Rangkap

Lambang yang digunakan untuk vocal rangkap adalah gabungan antara harakat dan huruf, dengan transliterasi berupa gabungan huruf.

Tanda Huruf	Tanda Baca	Huruf
ي	<i>Fathah dan ya</i>	<i>ai</i>
و	<i>Fathah dan waw</i>	<i>au</i>

Contoh:

كيف : kaifa

على : 'ala

حول : haula

أي : ai atau ay

Mad

Mad atau panjang dilambangkan dengan harakat atau huruf, dengan transliterasi berupa huruf atau benda:

Contoh:

Harkat dan huruf	Tanda baca	Keterangan
اي	<i>Fatha dan alif atau ya</i>	<i>a</i>
اي	<i>Kasroh dan ya</i>	<i>i</i>
او	<i>Dlommatain dan waw</i>	<i>u</i>

قال سبحانك : qala subhanaka

صام رمضان : shama ramadlana

رامي : rama

فيها منافع : fi manafi 'u

يكتبون ما يمكرون : yaktubuna ma yamkuruna

اذ قال يوسف لا بيه : iz qala yusufu liabihi

Ta' Marbutah

Transliterasi untuk ta marbutah ada dua macam:

1. Ta' Marbutah hidup atau yang mendapat harakat fatha, kasroh dan dlamamah, maka transliterasinya adalah /t/.
2. Ta' Marbutah yang mati atau mendapat harakat sukun, maka transliterasinya adalah /h/.
3. Kalau pada kata yang terakhir dengan ta marbutah diikuti dengan kata yang memakai al serta bacaan keduanya terpisah, maka ta marbutah itu ditransliterasikan dengan /h/.
4. Pola penulisan tetap 2 macam

Contoh:

رومضة الاطفال	Raudlatul athfal
المدينة المنورة	al-Madinah al-munawwarah

Syaddad (Tasydid)

Syaddah atau tasydid dalam system tulisan Arab dilambangkan dengan sebuah tanda, yaitu tanda syaddah atau tasydid. Dalam transliterasi ini tanda syaddah tersebut dilambangkan dengan huruf yang diberi tanda syaddah tersebut dilambangkan dengan huruf yang diberi tanda syaddah tersebut.

ربنا = Robbana نزل = Nazzala

Kata Sandang

Diikuti oleh Huruf Syamsiah

Kata sandang yang diikuti oleh huruf syamsiah ditransliterasikan bunyinya dengan huruf /I/ diganti dengan huruf yang langsung mengikutinya. Pola yang dipakau ada dua seperti berikut.

Contoh:

	Pola Penulisan	
التواب	<i>Al-tawwabu</i>	<i>At-tawwabu</i>
الشمس	<i>Al-syamsu</i>	<i>Asy-syamsu</i>

Diikuti huruf Qomariah

Kata sandang yang diikuti huruf qomariyah ditransliterasikan sesuai dengan aturan- aturan diatas dan dengan bunyinya.

Contoh:

	Pola Penulisan	
البدیع	<i>Al-badi'u</i>	<i>Al-badi'u</i>
القمر	<i>Al-qomaru</i>	<i>Al-qomaru</i>

Catatan : Baik diikuti huruf *syamsiah* maupun *qomariyah*, kata sandang ditulis secara terpisah dari kata yang mengikutinya dan diberi tanda hubung (-).

Hamzah

Hamzah ditransliterasikan dengan opostrof. Namun hal ini hanya berlaku bagi hamzah yang terletak ditengah dan akhir kata. Apabila terletak diawal kata, hamzah tidak dilambangkan karena dalam tulisannya ia berupa *alif*.

Contoh:

تاخذون	: <i>Ta'khuzuna</i>
الشهداء	: <i>Asy-syuhada'u</i>
اومرت	: <i>Umirtu</i>
فاتي بها	: <i>Fa'tibiha</i>

Penulisan Huruf

Pada dasarnya setiap kata, baik *fi'il*, *isim* maupun *huruf* ditulis terpisah. Hanya kata-kata tertentu yang penulisannya dengan huruf Arab sudah lazim dirangkaikan dengan kata-kata lain karena ada huruf atau harakat yang dihilangkan. Maka penulisan kata tersebut dirangkaikan juga dengan kata lain yang mengikutinya. Penulisan dapat menggunakan salah satu dari dua pola sebagai berikut:

Contoh	Pola Penulisan
وان لها هو خير الرازقين	<i>Wa innalaha lahuwa khair al-raziqin</i>
فاو فوا الكيل والميزان	<i>Fa aufu al-kaila wa al-mizani</i>

