

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....

HALAMAN PERSUTUJUAN

PERNYATAAN ORISINALITAS iii

DECLARATION iv

KATA PENGANTAR v

ABSTRAK viii

ABSTRACT..... ix

الملخص..... x

PEDOMAN..... xi

DAFTAR ISI..... xiv

DAFTAR TABEL..... xix

DAFTAR GAMBAR xx

DAFTAR PERSAMAAN xxi

DAFTAR LAMPIRAN..... xxii

BAB 1 PENDAHULUAN 1

1.1. Latar Belakang 1

1.2. Rumusan Masalah 9

1.3. Tujuan Penelitian 9

1.4. Manfaat Penelitian 10

1.5. Sistematika Penulisan 10

BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA 13

2.1. Landasan Teori..... 13

2.1.1. Perbankan.....	13
2.1.1.1. Bank Konvensional.....	20
2.1.1.2. Bank Syariah	24
2.1.2. Pasar Modal Syariah	33
2.1.2.1. Landasan Pasar Modal Syariah	36
2.1.2.2. Instrumen Pasar Modal Syariah.....	38
2.1.4. Investasi Syariah	40
2.1.5. Saham Syariah	44
2.1.6. Teori Sinyal (<i>Signalling Theory</i>)	47
2.1.7. Holding Period	48
2.1.8. Bid-Ask Spread	50
2.1.9. Return Saham.....	54
2.1.10. Volume Perdagangan	56
2.2. Hubungan Antar Variabel	59
2.2.1. Hubungan Bid-Ask Spread Terhadap Holding Period.....	60
2.2.2. Hubungan Return Saham Terhadap Holding Period	61
2.2.3. Hubungan Volume Perdagangan Terhadap Holding Period.....	62
2.3. Penelitian Terdahulu	62
2.4. Hipotesis.....	66
2.5. Model Analisis	67
2.6. Kerangka Berpikir.....	69
BAB III METODE PENELITIAN.....	70
1.1. Pendekatan Penelitian	70

1.2. Identifikasi Variabel.....	71
1.3. Definisi Operasional	72
1.4. Jenis dan Sumber Data.....	73
1.5. Prosedur Pengumpulan Data.....	74
1.5.1. Populasi dan Sampel.....	74
1.5.2. Pengumpulan Data.....	75
1.6. Teknik Analisis dan Pengelolaan Data	76
1.6.1. Uji Prasyarat Analisis	77
1.6.2. Uji Normalitas	77
1.6.3. Uji Multikolinieritas	78
1.6.4. Uji Autokorelasi	78
1.7. Uji Hipotesis	79
1.7.1. Analisis Regresi Linier Berganda.....	79
1.7.2. Uji Partial (uji t).....	80
1.7.3. Koefisien Determinasi (R^2)	80
1.8. Uji Beda	81
1.8.1. Uji Normalitas	81
1.8.2. Uji Hipotesis	82
BAB 4 PEMBAHASAN	83
4.1. Gambaran Umum Subjek dan Umum Objek Penelitian	83
4.1.1. Gambaran Umum Subjek Penelitian.....	83
4.1.2. Gambaran Umum Objek Penelitian	84
4.2. Deskripsi Hasil Penelitian	85

4.2.1. Holding Period	86
4.2.2. Bid-Ask Spread	87
4.2.3. Return Saham	88
4.2.4. Volume Perdagangan	88
4.3. Analisis Hasil Penelitian	89
4.3.1. Uji Asumsi Klasik	90
4.3.1.1. Uji Normalitas	90
4.3.1.2. Uji Multikolinieritas	92
4.3.1.3. Uji Autokorelasi	94
4.3.2. Uji Hipotesis	96
4.3.2.1. Analisis Regresi Linier Berganda	96
4.3.2.2. Uji Parsial (uji t)	97
4.3.2.3. Koefisien Determinasi (R^2)	101
4.3.3. Uji Beda	101
4.3.3.1. Uji Normalitas	101
4.3.3.2. Uji Hipotesis	103
4.4. Pembahasan	104
4.4.1. Pengaruh Secara Parsial Holding Period Saham Bank Umum Syariah	104
4.4.1.1 Pengaruh Bid-Ask Spread Terhadap Holding Period Saham Bank Umum Syariah	104
4.4.1.2. Pengaruh Return Saham Terhadap Holding Period Saham Bank Umum Syariah	106

4.4.1.3. Pengaruh Volume Perdagangan Terhadap Holding Period	
Saham Bank Umum Syariah.....	108
4.4.2. Pengaruh Secara Parsial Holding Period Saham Bank Umum	
Konvensional	109
4.4.2.1. Pengaruh Bid-Ask Spread Terhadap Holding Period Bank	
Umum Konvensional	109
4.4.2.2. Pengaruh Return Saham Terhadap Holding Period Saham Bank	
Umum Konvensional	111
4.4.2.3. Pengaruh Volume Perdagangan Terhadap Holding Period	
Saham Bank Umum Konvensional	113
4.4.3. Perbedaan Holding Period Saham Bank Umum Syariah dan Bank	
Umum Konvensional	114
BAB 5 KESIMPULAN DAN SARAN	121
5.1. Kesimpulan	121
5.2. Saran.....	123
DAFTAR PUSTAKA	125
LAMPIRAN.....	