FAKTOR – FAKTOR YANG MEMPENGARUHI RETURN SAHAM SYARIAH DAN SAHAM KONVENSIONAL DI BURSA EFEK INDONESIA

SKRIPSI

Ditulis dan diajukan untuk memenuhi syarat ujian akhir guna memperoleh gelar sarjana strata-1 di Jurusan Akuntansi, Fakultas Ekonomi, Universitas Islam Indonesia

Ditulis oleh:

Nama : Aprilia Maya Sari

NIM : 13312168

Jurusan : Akuntansi

UNIVERSITAS ISLAM INDONESIA

FAKULTAS EKONOMI

YOGYAKARTA

2019

PERNYATAAN BEBAS PLAGIARISME

"Dengan ini saya menyatakan bahwa dalam skripsi ini tidak terdapat karya yang diajukan orang lain untuk memperoleh gelar kesarjanaan di suatu perguruan tinggi, dan sepanjang pengetahuan saya juga tidak terdapat karya atau pendapat yang pernah ditulis atau diterbitkan oleh orang lain, kecuali yang secara tertulis diacu dalam naskah ini dan disebut dalam referensi. Apabila kemudian hari terbukti bahwa persyaratan ini tidak benar, saya sanggup menerima hukuman/sanksi apapun sesuai dengan peraturan yang berlaku"

Yogyakarta,

Penulis



Aprilia Maya Sari

ii

HALAMAN PENGESAHAN SKRIPSI

PERBEDAAN FAKTOR – FAKTOR YANG MEMPENGARUHI RETURN SAHAM SYARIAH DAN SAHAM KONVENSIONAL DI BURSA EFEK INDONESIA

Nama : Aprilia Maya Sari

Nomor Mahasiswa : 13312168

Jurusan : Akuntansi

Yogyakarta, 19 juni 2019

Telah disetujui oleh

Dosen Pembimbing,

Yunan Najamudin Drs.,M.B.A.

iii

BERITA ACARA UJIAN TUGAS AKHIR /SKRIPSI

SKRIPSI BERJUDUL

PERBEDAAN FAKTOR-FAKTOR YANG MEMPENGARUHI RETURN SAHAM SYARIAH DAN KONVENSIONAL DI BURSA EFEK INDONESIA.

Disusun Oleh : **APRILIA MAYA SARI**

Nomor Mahasiswa : **13312168**

Telah dipertahankan di depan Tim Penguji dan dinyatakan **LULUS**

Pada hari Selasa, tanggal: 9 Juli 2019

Penguji/ Pembimbing Skripsi : Yunan Najamuddin, Drs., MBA.

Penguji : Sigit Handoyo, SE., M.Bus

Mengetahui
Dekan Fakultas Ekonomi
Universitas Islam Indonesia

Jaka Sriyana, SE., M.Si, Ph.D.

MOTTO

“ Manusia lebih membutuhkan ilmu dari sekedar membutuhkan makan dan minum, karena makan dan minum dibutuhkan sekali atau dua kali sehari, sedang ilmu senantiasa dibutuhkan selama nafas masih dikandung badan ”

(Imam Ahmad bin Hambal)

“ Berhenti membuat rencana, MELANGKAHLAH!”

(Bob Sadino)

“Untuk mendapatkan yang Anda inginkan, Anda harus bersabar melalui yang tidak Anda inginkan. Maka tabahilah masa sulit yang sedang Anda alami, agar Anda sampai di masa mudah dan makmur Anda”

(Mario Teguh)

KATA PENGANTAR

بِسْمِ اللهِ الرَّحْمٰنِ الرَّحِيْمِ

Assalamu'alaikum warahmatullahi wabarakatuh

Alhamdulillahirabbil'alamin, segala puji dan syukur atas kehadirat Allah SWT atas segala rahmat dan karunia-Nya, sehingga penulis dapat menyelesaikan proposal penelitian untuk menyelesaikan tugas akhir yaitu karya tulis ilmiah atau skripsi. Tak lupa shalawat dan salam kepada junjungan kita, Nabi Muhammad SAW dengan segala keistimewaan-Nya sebagai tauladan bagi seluruh umat manusia di bumi sehingga kita dapat menjadi insan yang lebih berguna dan bermanfaat bagi sesama manusia.

Selama proses penulisan proposal penelitian ini penulis mengalami proses yang cukup menguras waktu dan pikiran. Dalam menyusun proposal penulisan penulis mendapat bantuan, dukungan, semangat, doa dan informasi dari berbagai pihak. Pada kesempatan ini, penulis dengan segala kerendahan hati ingin menyampaikan ucapan terimakasih kepada :

1. Allah SWT, yang tidak henti – hentinya selalu memberikan jalan keluar pada setiap permasalahanku, dan kemudahan terutama selama pengerjaan skripsi ini.
2. Rasullullah yang telah membawa manusia dari zaman kegelapan ke zaman terang menerang sehingga membuat kehidupan manusia menjadi lebih baik lagi.
3. Alm Bapak Soemardi dan Alm Ibu Chotijah, kakek dan nenek saya yang selalu membuat saya semangat untuk menyelesaikan Tugas Akhir ini.

4. Bapak Rudi Taryanto ayah kandung saya , Ibu Sugiyanti ibu kandung saya, Anugrah Yogi Syahputra dan Devita Fitria Ningrum Adik kandung saya yang selalu memberikan doa, dukungan, motivasi, nasihat, bimbingan dan semangat sehingga Tugas Akhir Skripsi ini dapat terselesaikan.
5. Tunangan Saya Andhika Tirta Herwin Pradana yang tiada henti selalu mendampingi saya skripsi, memberikan dorongan serta dukungan penuh, semangat, dan doa untuk saya sehingga Tugas Akhir ini terselesaikan.
6. Bapak Yunan Najamudin Drs.,M.B.A. selaku dosen pembimbing skripsi atas segala bimbingan, motivasi dan informasi yang diberikan selama penyusunan Tugas Akhir Skripsi.
7. Yunita selaku rekan yang telah memberikan pelajaran, arahan, bimbingan, semangat serta waktu dalam menyusun Tugas Akhir Skripsi.
8. Sahabat-sahabat saya Roy Hanatul M dan Fhavia Octavia yang telah senantiasa menghibur dan memotivasi penulis dalam proses pengerjaan Tugas Akhir Skripsi ini.
9. Ibu Erni Tri bagian Pojok Bursa Efek Indonesia (BEI) Fakultas Ekonomi Universitas Islam Yogyakarta yang telah membantu saya dalam proses pengumpulan data.

10. Semoga Tugas Akhir Skripsi ini memberikan manfaat, serta menambah khasanah ilmu pengetahuan bagi kita semua, Aamiin.

Wassalamu'alaikumwarahmatullahiwabarakatuh

Yogyakarta, 2019

Penulis,

Aprilia Maya Sari