

**ANALISIS PERBANDINGAN VOLATILITAS HISTORIS SAHAM
DAN VOLUME PERDAGANGAN SAHAM
PADA PERUSAHAAN PRODUK KONSUMSI
DI JAKARTA ISLAMIC INDEX (JII)
SEBELUM DAN SELAMA
PANDEMI COVID-19**

SKRIPSI

Sebagai Salah Satu Syarat Untuk Memperoleh Gelar
Sarjana Manajemen
Pada Program Studi Manajemen



MAIDAH AHMAD

NIM: 2018111020028

INSTITUT TEKNOLOGI BISNIS AHMAD DAHLAN

JAKARTA

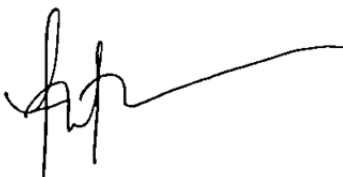
2022

LEMBAR PERSETUJUAN SKRIPSI

Nama : Maidah Ahmad
NIM : 2018111020028
Jurusan : S1 Manajemen
Bidang/Konsentrasi : Manajemen Keuangan
Judul Skripsi : Analisis Perbandingan Volatilitas Historis Saham Dan Volume Perdagangan Saham Pada Perusahaan Produk Konsumsi di *Jakarta Islamic Index* (JII) Sebelum Dan Selama Pandemi Covid-19

Telah disetujui dan lanjut disidangkan untuk memenuhi sebagian dari persyaratan guna memperoleh gelar Sarjana Manajemen.

Mengetahui,
Ketua Program Studi Manajemen



(Tito Siswanto, S. E., M. M)
NIDN: 0305108704

Menyetujui,
Pembimbing Skripsi



(Husnayetti, S. E., M. M)
NIDN: 0303036702

LEMBAR PENGESAHAN

Judul Skripsi : Analisis Perbandingan Volatilitas Historis Saham Dan Volume Perdagangan Saham Pada Perusahaan Produk Konsumsi di *Jakarta Islamic Index (JII)* Sebelum Dan Selama Pandemi Covid-19

Nama : Maidah Ahmad

Prodi/Konsentrasi : S1 Manajemen/Manajemen Keuangan Telah diujikan pada tanggal 25 Februari 2022 di hadapan Tim Penguji Sidang skripsi dan dinyatakan lulus.

Pembimbing Skripsi,



(Husnayetti, S.E., M.M)
NIDN: 0303036702

Penguji Skripsi,



(Yenni Oktaviani, S.E.I., M.A.Ek.)
NIDN: 0314108604

Ketua Program Studi Manajemen



(Tito Siswanto, S.E., M.M)
NIDN: 0305108704

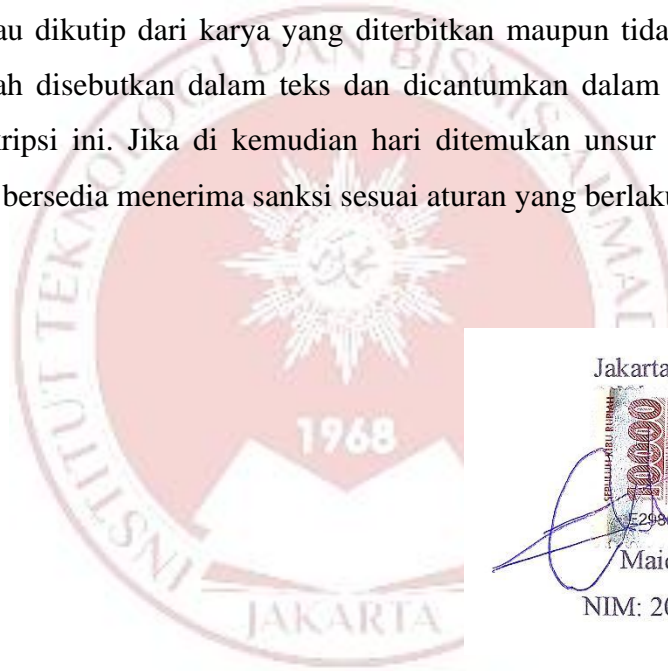
Wakil Ketua I Bidang Akademik



(Setia Budi, S.E., M.M)
NIDN: 0009057901

PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI

Dengan ini saya menyatakan bahwa skripsi dengan judul “Analisis Perbandingan Volatilitas Historis Saham Dan Volume Perdagangan Saham Pada Perusahaan Produk Konsumsi di *Jakarta Islamic Index* (JII) Sebelum Dan Selama Pandemi Covid-19” adalah hasil karya saya dengan arahan dari dosen pembimbing yang diajukan untuk memenuhi salah satu syarat memperoleh gelar strata satu (S1) pada Institut Teknologi Bisnis Ahmad Dahlan Jakarta. Karya saya ini belum diajukan dalam bentuk apapun kepada perguruan tinggi manapun. Dengan sumber informasi yang berasal atau dikutip dari karya yang diterbitkan maupun tidak diterbitkan dari penulis lain telah disebutkan dalam teks dan dicantumkan dalam daftar pustaka di bagian akhir skripsi ini. Jika di kemudian hari ditemukan unsur plagiarism dalam skripsi ini, saya bersedia menerima sanksi sesuai aturan yang berlaku.



Jakarta, 25 Maret 2022



Maidah Ahmad

NIM: 2018111020028

HALAMAN PERSEMBAHAN

Puji syukur saya ucapkan kehadirat Allah SWT yang telah melimpahkan rahmat dan karunia-Nya sehingga saya dapat menyelesaikan penyusunan skripsi yang berjudul “Analisis Perbandingan Historical Volatility Harga Saham Dan Volume Perdagangan Saham Pada Perusahaan Produk konsumsi di Jakarta Islamic Index (JII) Sebelum Dan Selama Pandemi Covid-19”, dan diajukan sebagai salah satu syarat untuk mendapat gelar Sarjana pada Jurusan Manajemen, Institut Teknologi Bisnis Ahmad Dahlan Jakarta.

Teruntuk Mamaku tersayang Masrianah

Ayahku tersayang Ahmad Husin

Abangku tersayang Hidayatullah

Teman seperjuangan bimbingan skripsi

Saudara dan Teman-Temanku yang tiada henti memberikan dukungan dan motivasi

Teman seperjuangan prodi Manajemen ITB Ahmad Dahlan Jakarta Tahun 2018

Saya mengucapkan terimakasih kepada pihak-pihak yang terlibat langsung maupun tidak langsung atas selesainya skripsi ini. Keberhasilan ini bukan hanya karena kepandaian penulis semata, melainkan doa, kasih sayang dan dukungan yang tulus dari keluarga tercinta serta teman-teman yang namanya tidak bisa saya sebutkan satu persatu dalam memberikan semangat dan motivasi yang kuat. Semoga Allah melimpahkan segala rahmat dan karunianya kepada kalian dan semoga skripsi ini dapat berguna untuk kemajuan ilmu pengetahuan di masa yang akan datang. Aamiin.

KATA PENGANTAR

Assalamu'alaikum Wr. Wb.

Segala puji dan syukur kita ucapkan atas kehadiran Allah SWT karena berkat rahmat dan petunjuk-Nya penulis dapat menyelesaikan karya ilmiah ini dengan baik.

Proposal skripsi ini penulis buat dengan menggunakan objek *Jakarta Islamic Index* (JII) yang dilaksanakan selama 6 bulan berdasarkan referensi buku serta pemikiran yang ada tentang rencana bisnis penulis sehingga dapat menghasilkan pemikiran yang dapat dipertanggungjawabkan hasilnya.

Penulis menyadari bahwa skripsi ini tidak mungkin terselesaikan tanpa adanya doa, dukungan, bantuan, bimbingan, serta motivasi dari berbagai pihak selama penyusunan skripsi ini terutama kepada dosen pembimbing ibu Husnayetti S.E., M.M, akhirnya penulis dapat menyelesaikan skripsi ini, oleh karena itu penulis menyampaikan rasa terima kasih yang sebesar-besarnya.

Tentunya skripsi ini masih jauh dari kata sempurna dan terdapat banyak kekurangan penulis berharap bagi pembaca agar dapat memberikan kritik yang membangun serta saran yang dapat membuat pemikiran penulis akan skripsi ini semakin luas. Demikian skripsi ini dibuat dengan sebenar-benarnya, semoga skripsi ini dapat bermanfaat bagi orang banyak. Mohon maaf atas segala kesalahan dan kekurangan karena kesempurnaan hanyalah milik Allah Subhanahu Wata'ala.

Jakarta, 13 Februari 2022

Maidah Ahmad

2018111020028

DAFTAR ISI

LEMBAR PERSETUJUAN SKRIPSI	Error! Bookmark not defined.
LEMBAR PENGESAHAN	3
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	4
HALAMAN PERSEMBAHAN	5
KATA PENGANTAR	6
ABSTRAK	Error! Bookmark not defined.
DAFTAR ISI	7
DAFTAR GAMBAR	9
DAFTAR TABEL	11
BAB I PENDAHULUAN	Error! Bookmark not defined.
1.1 Latar Belakang	Error! Bookmark not defined.
1.2 Pembatasan Masalah	Error! Bookmark not defined.
1.3 Rumusan Masalah	Error! Bookmark not defined.
1.4 Tujuan Penelitian	Error! Bookmark not defined.
1.5 Manfaat Penelitian	Error! Bookmark not defined.
BAB II TINJAUAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN, DAN HIPOTESIS	Error! Bookmark not defined.
2.1. Tinjauan Pustaka	Error! Bookmark not defined.
2.1.1 Manajemen Keuangan.....	Error! Bookmark not defined.
2.1.2 Pasar Modal.....	Error! Bookmark not defined.
2.1.3 Investasi	Error! Bookmark not defined.
2.1.4 Saham.....	Error! Bookmark not defined.
2.1.5 Harga Saham	Error! Bookmark not defined.
2.1.6 Teori Sinyal.....	Error! Bookmark not defined.
2.1.7 <i>Jakarta Islamic Index (JII)</i>	Error! Bookmark not defined.
2.1.8 Volatilitas Harga Saham	Error! Bookmark not defined.
2.1.9 <i>Historical Volatility</i>	Error! Bookmark not defined.
2.1.10 Volume Perdagangan Saham	Error! Bookmark not defined.
2.1.11 Hubungan Volatilitas Harga Saham dengan Volume Perdagangan Saham	Error! Bookmark not defined.

2.1.12 COVID-19.....	Error! Bookmark not defined.
2.2 Penelitian Terdahulu	Error! Bookmark not defined.
2.3 Kerangka Berpikir.....	Error! Bookmark not defined.
2.4 Hipotesis.....	Error! Bookmark not defined.
BAB III METODE PENELITIAN	Error! Bookmark not defined.
3.1 Desain Penelitian.....	Error! Bookmark not defined.
3.2 Objek dan Waktu Penelitian.....	Error! Bookmark not defined.
3.2.2 Objek Penelitian	Error! Bookmark not defined.
3.2.3 Waktu Penelitian	Error! Bookmark not defined.
3.3 Variabel Penelitian	Error! Bookmark not defined.
3.4 Operasional Variabel.....	Error! Bookmark not defined.
3.5 Teknik Pengumpulan Data.....	Error! Bookmark not defined.
3.6 Teknik Pengumpulan Sampel	Error! Bookmark not defined.
3.7 Teknik Analisis Data.....	Error! Bookmark not defined.
3.7.1 Analisis statistik deskriptif.....	Error! Bookmark not defined.
3.7.2 Uji Normalitas	Error! Bookmark not defined.
3.7.3 Uji Hipotesis	Error! Bookmark not defined.
3.7.4 Uji Wilcoxon.....	Error! Bookmark not defined.
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	Error! Bookmark not defined.
4.1 Deskripsi Objek Penelitian.....	Error! Bookmark not defined.
4.1.1 Sejarah Singkat Perusahaan	Error! Bookmark not defined.
4.2 Deskripsi Data	Error! Bookmark not defined.
4.2.1 Volatilitas Harga Saham (PV)..	Error! Bookmark not defined.
4.2.2 Volume Perdagangan Saham ...	Error! Bookmark not defined.
4.3 Analisis dan Interpretasi Hasil	Error! Bookmark not defined.
4.3.1 Uji Normalitas Variabel Volatilitas Harga Saham.....	Error! Bookmark not defined.
4.3.2 Uji Normalitas Variabel Volume Perdagangan Saham....	Error! Bookmark not defined.
4.3.3 Pengujian Hipotesis Variabel Volatilitas Harga Saham...	Error! Bookmark not defined.

4.3.4 Pengujian Hipotesis Variabel Volume Perdagangan Saham **Error! Bookmark not defined.**

4.3.5 Interpretasi Hasil Penelitian**Error! Bookmark not defined.**

BAB V SIMPULAN DAN SARAN**Error! Bookmark not defined.**

5.1 Simpulan**Error! Bookmark not defined.**

5.2 Saran.....**Error! Bookmark not defined.**

Daftar Pustaka.....**Error! Bookmark not defined.**

LAMPIRAN.....**Error! Bookmark not defined.**



DAFTAR GAMBAR

Gambar 1. 1 Harga Penutupan Saham Jakarta Islamic Index (JII) 2018-2021 **Error! Bookmark not defined.**

Gambar 2. 1 Kerangka Pemikiran.....**Error! Bookmark not defined.**



DAFTAR TABEL

Tabel 3. 1 Operasional Variabel.....**Error! Bookmark not defined.**

Tabel 3. 2 Sampel Saham Produk konsumsi di JII 2018-2021**Error! Bookmark not defined.**

Tabel 4. 1 Statistik Deskriptif Volatilitas Harga Saham pada Perusahaan Indofood CBP Sukses Makmur Tbk. sebelum dan selama pandemi COVID-19..... **Error! Bookmark not defined.**

Tabel 4. 2 Statistik Deskriptif Volatilitas Harga Saham pada Perusahaan Indofood Sukses Makmur Tbk. sebelum dan selama pandemi COVID-19**Error! Bookmark not defined.**

Tabel 4. 3 Statistik Deskriptif Volatilitas Harga Saham pada Perusahaan Unilever Indonesia Tbk. sebelum dan selama pandemi COVID-19... **Error! Bookmark not defined.**

Tabel 4. 4 Statistik Deskriptif Volume Perdagangan Saham pada Indofood CBP Sukses Makmur Tbk. sebelum dan selama pandemi COVID-19.**Error! Bookmark not defined.**

Tabel 4. 5 Statistik Deskriptif Volume Perdagangan Saham pada Indofood Sukses Makmur Tbk. sebelum dan selama pandemi COVID-19. ... **Error! Bookmark not defined.**

Tabel 4. 6 Statistik Deskriptif Volume Perdagangan Saham pada Unilever Indonesia Tbk. sebelum dan selama pandemi COVID-19.**Error! Bookmark not defined.**

Tabel 4. 7 Uji Normalitas Data Variabel Volatilitas Harga Saham sebelum dan selama Pandemi COVID-19.....**Error! Bookmark not defined.**

Tabel 4. 8 Uji Normalitas Data Variabel Volatilitas Harga Saham sebelum dan selama Pandemi COVID-19 PT Indofood Sukses Makmur Tbk. **Error! Bookmark not defined.**

Tabel 4. 9 Uji Normalitas Data Variabel Volatilitas Harga Saham sebelum dan selama Pandemi COVID-19 PT Unilever Indonesia Tbk. .**Error! Bookmark not defined.**

Tabel 4. 10 Uji Normalitas Data Variabel Volume Perdagangan Saham Indofood CBP Sukses Makmur Tbk. sebelum dan selama Pandemi COVID-19..... **Error! Bookmark not defined.**

Tabel 4. 11 Uji Normalitas Data Variabel Volume Perdagangan Saham Indofood CBP Sukses Makmur Tbk. sebelum dan selama Pandemi COVID-19..... **Error! Bookmark not defined.**

Tabel 4. 12 Uji Normalitas Data Variabel Volume Perdagangan Saham Unilever Indonesia Tbk. sebelum dan selama Pandemi COVID-19... **Error! Bookmark not defined.**

Tabel 4. 13 Hasil Uji *Paired Sample T-Test* Volatilitas Harga Saham sebelum dan selama Pandemi COVID-19 pada PT. Indofood CBP Sukses Makmur Tbk. **Error! Bookmark not defined.**

Tabel 4. 14 Hasil Uji *Paired Sample T-Test* Volatilitas Harga Saham sebelum dan selama Pandemi COVID-19 pada PT. Indofood Sukses Makmur Tbk. **Error! Bookmark not defined.**

Tabel 4. 15 Hasil Uji *Paired Sample T-Test* Volatilitas Harga Saham sebelum dan selama Pandemi COVID-19 pada PT. Unilever Indonesia Tbk.**Error! Bookmark not defined.**

Tabel 4. 16 Hasil Uji Hipotesis Volume Perdagangan Saham Indofood CBP Sukses Makmur Tbk. sebelum dan selama Pandemi COVID-19 **Error! Bookmark not defined.**

Tabel 4. 17 Hasil Uji Hipotesis Volume Perdagangan Saham Indofood Sukses Makmur Tbk. sebelum dan selama Pandemi COVID-19 **Error! Bookmark not defined.**

Tabel 4. 18 Hasil Uji Hipotesis Volume Perdagangan Saham Indofood Sukses Makmur Tbk. sebelum dan selama Pandemi COVID-19 **Error! Bookmark not defined.**

