

ABSTRAK

Arum Mediyawati, NIM: 1520210010 dengan judul **“Dampak Peristiwa Aksi Bela Islam 2 Desember (Aksi 212) Tahun 2016 terhadap *Abnormal Return* dan *Trading Volume Activity* (pada Saham Syariah yang Terdaftar di *Jakarta Islamic Index*)”** pada Jurusan Syariah dan Ekonomi Islam, Program Studi Ekonomi Syariah (ES).

Penelitian ini menguji dampak aksi 212 tahun 2016 sebagai faktor eksternal perusahaan terhadap kinerja harga saham yang dalam hal ini ditunjukkan dengan volatilitas pergerakan *abnormal return* dan *trading volume activity* pada saham syariah yang terdaftar di *Jakarta Islamic Index* (JII).

Penelitian ini menggunakan *event study* dengan dilakukan pengamatan selama 7 hari sebelum peristiwa, 1 hari saat peristiwa, dan 7 hari setelah peristiwa. Data yang digunakan adalah data sekunder yang berupa data harian harga saham, data harian indeks JII, data harian volume perdagangan dan data harian volume saham yang beredar selama periode pengamatan 15 hari. Pengambilan sampel menggunakan teknik *purposive sampling* dan jenis data yang digunakan adalah data kuantitatif. Sampel pengujian hipotesis pada penelitian ini dibedakan menjadi 2 yaitu seluruh saham syariah yang terdaftar di JII dan kelompok saham perusahaan manufaktur dan non manufaktur yang terdaftar di JII. Alasan pengelompokan ini dimaksudkan agar dapat mengetahui perbedaan *abnormal return* dan *trading volume activity* baik untuk keseluruhan saham syariah yang terdaftar di JII maupun kelompok saham perusahaan manufaktur dan non manufaktur di JII. Pengujian terhadap hipotesis menggunakan *paired sample t-test*.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa terdapat perbedaan yang signifikan *average abnormal return* dan tidak terdapat perbedaan rata-rata *trading volume activity* sebelum dan setelah peristiwa pada saham syariah yang terdaftar di JII. Sedangkan pada saham syariah perusahaan manufaktur dan non manufaktur tidak terdapat perbedaan *average abnormal return* dan rata-rata *trading volume activity*.

Kata Kunci: *Event study, abnormal return, trading volume activity, JII, Aksi 212 Tahun 2016*