

**PENGARUH FREKUENSI PERDAGANGAN SAHAM, VOLUME
PERDAGANGAN SAHAM DAN KAPITALISASI PASAR TERHADAP
RETURN SAHAM PERUSAHAAN YANG TERDAFTAR DI
JAKARTA ISLAMIC INDEX PERIODE 2016-2018**



SKRIPSI

**Diajukan Untuk Memenuhi Salah Satu Syarat
Guna Memperoleh Gelar Sarjana Strata Satu (S1)
Dalam Ilmu Ekonomi Syariah**

Oleh :

OZY LAHANA AVONITA

NIM: 1620210120

**INSTITUT AGAMA ISLAM NEGERI KUDUS
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS ISLAM
PROGRAM STUDI EKONOMI SYARIAH
2020**



KEMENTERIAN AGAMA REPUBLIK INDONESIA
INSTITUT AGAMA ISLAM NEGERI KUDUS
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS ISLAM
Jalan Conge ngembalrejo PO Box 51, Kudus 59322, Telp (0291) 432677 Faks 441623
Email : febi@iainkudus.ac.id Website : www.iainkudus.ac.id

PERSETUJUAN PEMBIMBING SKRIPSI

Yang bertanda tangan di bawah ini menyatakan bahwa Skripsi saudara:

Nama : Ozy Lahana Avonita
NIM : 1620210120
Fakultas : Ekonomi dan Bisnis Islam
Program Studi : Ekonomi Syariah
Judul : Pengaruh Frekuensi Perdagangan Saham, Volume
Perdagangan Saham dan Kapitalisasi Pasar terhadap
Return Saham Perusahaan yang Terdaftar di Jakarta
Islamic Index Periode 2016-2018

benar-benar telah melalui proses pembimbingan dengan pembimbing sejak 9 Desember 2019 sampai dengan 13 Mei 2020 dan disetujui untuk dapat melanjutkan ke proses munaqosyah.

Kudus, 18 Mei 2020
Dosen Pembimbing

Irsad Andrivanto, SE, M.Si
NIP. 198001012008011031



KEMENTERIAN AGAMA RI
INSTITUT AGAMA ISLAM NEGERI KUDUS
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS ISLAM
 Jl. Conge Ngembalrejo Kotak Pos 51 Kudus 59322 Telp.
 (0291) 432677

PENGESAHAN MUNAQOSYAH

Yang bertandatangan di bawah ini menyatakan bahwa skripsi saudara:

Nama/NIM : Ozy Lahana Avonita / 1620210120
Fakultas/Prodi : Ekonomi dan Bisnis Islam / Ekonomi Syariah
Judul : Pengaruh Frekuensi Perdagangan Saham, Volume Perdagangan Saham, dan Kapitalisasi Pasar terhadap Return Saham Perusahaan yang Terdaftar di Jakarta Islamic Index Periode 2016 - 2018

telah diujikan pada **05 Juni 2020** dan dinyatakan **LULUS** dalam Ujian Majelis Munaqosyah Skripsi, sehingga dapat dilakukan Yudisium Sarjana.

NAMA	TANGGAL	TANDA TANGAN
Ketua/Penguji I <u>Dr. Nor Hadi, SE., M.Si., Akt.</u> NIP. 196909032003121001	11 - 06 - 2020	
Penguji II <u>M. Arif Hakim, M.Ag.</u> NIP. 197901072005011006	11 - 06 - 2020	
Sekretaris/Penguji III <u>Ita Rakhmawati, S.Pd., M.Si.</u> NID. 198604182024042016	11 - 06 - 2020	
Dosen Pembimbing <u>Irsad Andrivanto, SE., M.Si.</u> NIP. 198001012008011031	11 - 06 - 2020	
Dekan <u>Dr. Suprivadi, SH, MH</u> NIP. 197210201999031001	11 - 06 - 2020	



PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI

Dengan penuh kejujuran dan tanggung jawab, saya Ozy Lahana Avonita NIM. 1620210120 menyatakan dengan sesungguhnya bahwa skripsi ini :

1. Seluruhnya merupakan karya saya sendiri dan belum pernah diterbitkan dalam bentuk dan untuk keperluan apapun; dan
2. Tidak berisi material yang pernah ditulis orang lain kecuali informasi yang terdapat dalam referensi yang dijadikan rujukan dalam penulisan skripsi ini.

Saya bersedia menerima sanksi apabila di kemudian hari ditemukan ketidakbenaran pernyataan saya ini.

Kudus, 13 Mei 2020

Yang Menyatakan,



Ozy Lahana Avonita
NIM. 1620210120

MOTTO

وَإِذَا رَأَوْا تِجْرَةً أَوْ هَمَّوْا أَنْفَضُوا إِلَيْهَا وَتَرَكُوكَ قَائِمًا قُلْ

مَا عِنْدَ اللَّهِ خَيْرٌ مِنَ اللَّهِ وَ مِنَ التِّجْرَةِ وَاللَّهُ خَيْرٌ

الرَّزْقِينَ

Artinya: “dan apabila mereka melihat perniagaan atau permainan, mereka bubar untuk menuju kepadanya dan mereka tinggalkan kamu sedang berdiri (berkhotbah). Katakanlah: "Apa yang di sisi Allah lebih baik daripada permainan dan perniagaan", dan Allah Sebaik-baik pemberi rezki.” (QS. Al Jumu’ah).¹

¹ Tim Penulis Naskah Al-Qur’an, *Al-Qur’an dan Terjemahannya*, (Kudus: Mubarakatan Thoyibah, 2018), 524.

PERSEMBAHAN

Sujud syukur ku persembahkan pada Allah Yang Maha Kuasa, berkat dan rahmat detak jantung, denyut nadi, nafas dan putaran roda kehidupan yang diberikan-Nya hingga saat ini penulis dapat mempersembahkan skripsi penulis pada orang-orang tersayang:

- ❖ Abah dan Ibu tercinta (Abah Sudaryono (alm) dan Ibu Puji Astarini) yang tak pernah lelah membesarkanku dengan penuh kasih sayang, serta memberi doa, dukungan, perjuangan, motivasi dan pengorbanan dalam hidup ini.
- ❖ Bapak Irsad Andriyanto, SE, M.Si., selaku Dosen Pembimbing yang telah bersedia meluangkan waktu untuk berkonsultasi, memberikan pengarahan dan bimbingan selama ini. Terima kasih atas ilmu, saran dan bimbingan yang telah Bapak berikan semoga Allah SWT selalu membalasnya dengan kebaikan.
- ❖ Calon pendamping hidupku (Budi Purnomo) yang selalu siap mendengar keluh kesah, selalu memberikan semangat, dukungan, dan selalu siap membantu ketika sedang memerlukan bantuan.
- ❖ Kakak-kakak ku tersayang (Muhammad Reza Yusuf dan Ayu Rizka Arfiani) yang selalu memberikan doa yang terbaik untuk adiknya.
- ❖ Saudara-saudaraku (M. Luqman Firmansyah, Nurul Husna, M.Rizka, dan Tsaniya Nailil Muna) yang selalu siap membantu saya ketika sedang memerlukan bantuan.
- ❖ Sahabat-sahabat saya (Asro Fina, Ainun Jamalia, Eka Ayu Rusiana, dan Siti Muntafaah) yang selalu siap mendengar keluh kesah dan selalu memberi semangat.
- ❖ Teman-temanku Ekonomi Syariah (ES) kelas D angkatan 2016, yang telah menjadi pemanis dan pewarna kehidupan perkuliahan selama 8 semester ini.
- ❖ Serta teman dan sanak saudara lainnya yang tidak mampu penulis ungkap satu persatu.

PEDOMAN TRANSLITERASI ARAB-LATIN
1. KONSONAN

HURUF ARAB	NAMA	HURUF LATIN	NAMA
أ	Alif	Di lambangkan	Tidak di lambangkan
ب	Ba	B	Be
ت	Ta	T	Te
ث	Sa	S	es (dengan titik di atas)
ج	Jim	J	Je
ح	Ha	H	Ha (dengan titik di bawah)
خ	kha	Kh	Ka dan ha
د	dal	D	De
ذ	zal	Z	Zet (dengan titik di atas)
ر	ra	R	Er
ز	za	Z	Zet
س	sin	S	Es
ش	syin	Sy	Es dan ye
ص	sad	S	Es (dengan titik di bawah)
ض	dad	D	de (dengan titik di bawah)
ط	ta	T	te (dengan titik di bawah)
ظ	za	Z	zet (dengan titik di bawah)
ع	‘ain	‘	Koma terbalik di atas
غ	‘gain	G	Ga
ف	Fa	Fa	Ef
ق	qaf	Q	Ki
ك	kaf	K	Ka
ل	lam	L	El
م	mim	M	Em
ن	nun	N	En

HURUF ARAB	NAMA	HURUF LATIN	NAMA
و	wau	W	We
هـ	Ha	H	Ha
ى	Hamzah	‘	Apostrop
ي	Ya	Y	Ye

2. VOKAL

a. Vokal Tunggal

Tanda	Nama	Huruf Latin	Nama
َ	Fathah	A	A
ِ	Kasroh	I	I
ُ	Dhummah	U	U

b. Vokal Rangkap

Tanda dan Huruf	Nama	Gabungan Huruf	Nama
يَ اِ	Fathah dan ya	Ai	a dan i
وَ اِ	Fathah dan wawu	Au	a dan u

c. Maddah atau Vokal Panjang

Harokat dan Huruf	Nama	Huruf dan Tanda	Nama
يَ اِ	Fathah dan alif atau ya'	Â	a dan garis di atas
يِ اِ	Kasroh dan ya'	Î	i dan garis di atas
يُ اِ	Dhummah wawu	Û	u dan garis di atas

KATA PENGANTAR

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ

Segala puji bagi Allah SWT yang telah melimpahkan rahmat, taufiq dan hidayah-Nya, sehingga pada kesempatan ini peneliti dapat menyelesaikan skripsi ini.

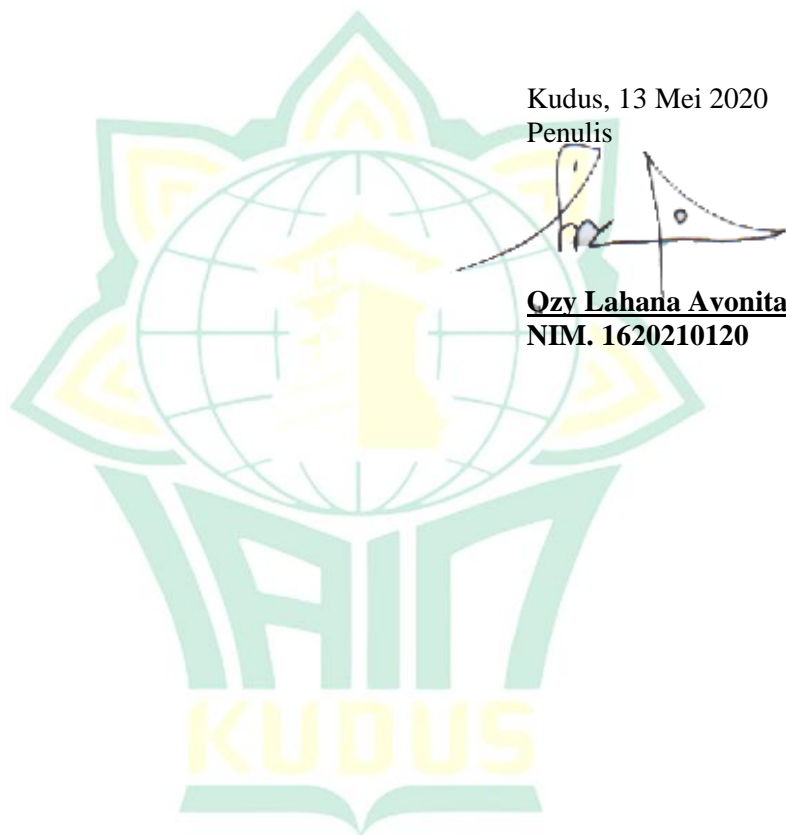
Skripsi yang berjudul **“Pengaruh Frekuensi Perdagangan Saham, Volume Perdagangan Saham dan Kapitalisasi Pasar terhadap Return Saham Perusahaan yang Terdaftar di Jakarta Islamic Index periode 2016-2018”**. Ini disusun guna memenuhi salah satu syarat memperoleh gelar Sarjana Strata 1 (satu) pada Ekonomi Syariah di Institut Agama Islam Negeri Kudus.

Penyusunan skripsi ini peneliti banyak mendapatkan bimbingan dan saran-saran dari berbagai pihak, sehingga penyusunan skripsi ini dapat terealisasi. Untuk itu peneliti menyampaikan terima kasih kepada:

1. Dr. H. Mundakir, M.Ag., selaku Rektor IAIN Kudus.
2. Dr. Supriyadi, S.H., M.H., selaku Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam IAIN Kudus.
3. Irsad Andriyanto, SE, M.Si., selaku Dosen Pembimbing yang telah bersedia meluangkan waktu, tenaga dan pikiran untuk memberikan bimbingan, pengarahan dalam penyusunan skripsi ini.
4. Anisa Listiana, M.Ag., selaku Kepala Perpustakaan IAIN Kudus yang telah memberikan izin dan layanan perpustakaan yang diperlukan dalam penyusunan skripsi ini.
5. Para Dosen atau Staf Pengajar di lingkungan Institut Agama Islam Negeri Kudus yang membekali berbagai pengetahuan sehingga penulis mampu menyelesaikan penyusunan skripsi ini.
6. Bapak dan Ibu yang tidak henti-hentinya melantunkan doa, mencurahkan kasih sayang, dukungan, nasehat, semangat dan perhatian. Terima kasih atas semuanya, semoga Allah SWT selalu menyayangi Bapak dan Ibu.
7. Teman-temanku seperjuangan yang sama-sama memberikan motivasi dan semangat kebersamaan dalam menyelesaikan skripsi ini.

Akhirnya, peneliti menyadari bahwa penyusunan skripsi ini masih jauh mencapai kesempurnaan dalam arti sebenarnya. Karena itu, kritik konstruktif dari siapapun diharapkan menjadi semacam suara yang dapat menyapa tulisan ini sebagai bahan pertimbangan dalam

proses kreatif berikutnya. Namun demikian, sekecil apapun makna yang terjelma dalam tulisan inipun juga diharapkan ada manfaatnya bagi penulis sendiri dan pembaca pada umumnya.



Kudus, 13 Mei 2020

Penulis

A handwritten signature in black ink, appearing to read 'Qzy Lahana Avonita', is written over the logo area.

Qzy Lahana Avonita
NIM. 1620210120