

ABSTRAK

Nur Lailatul Isna, 1620210096, Analisis Komparasi *Abnormal Return*, *Trading Volume Activity*, dan *Security Volume Activity* Sebelum dan Sesudah Kebijakan Work From Home Saat Pandemi Covid-19 Pada Maret 2020 (*Event Study* pada Saham Syariah yang Terdaftar di *Jakarta Islamic Index*)

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui adanya perbedaan pada *abnormal return*, *trading volume activity*, dan *Security Volume Activity* Sebelum dan Sesudah Kebijakan Work From Home Saat Pandemi Covid-19 Pada Maret 2020. Penelitian ini menggunakan data sekunder, populasinya yaitu perusahaan yang telah terdaftar di *Jakarta Islamic Index* pada Maret 2020. Teknik pengambilan sampel yang dilakukan adalah metode sampel jenuh. Sampel yang diperoleh sebanyak 30 perusahaan.

Metode penelitian telah dilakukan dengan menggunakan metode kuantitatif dimana hasilnya dapat diperoleh dengan menghitung data sekunder yang berhubungan dengan penelitian. Metode analisis yang digunakan adalah uji normalitas data menggunakan *One Sample Kolmogorov Smirnov Test*, menggunakan uji beda *paired sample t-test* dan *wilcoxon signed rank*

Hasil penelitian ini, bahwa tidak terdapat perbedaan pada *abnormal return* saham dengan nilai signifikansi sebesar 0,176, menunjukkan peristiwa tersebut tidak memberikan pengaruh yang signifikan. Dan hipotesis kedua, bahwa tidak terdapat perbedaan *trading volume activity* dengan nilai sebesar 0,884, menunjukkan peristiwa tersebut tidak memberikan pengaruh yang signifikan. Sedangkan pada hipotesis ketiga dengan nilai signifikansi 0,023, menunjukkan peristiwa tersebut memberikan pengaruh yang signifikan.

Kata kunci : *Event study*, *Abnormal Return*, *Trading Volume Activity*, dan *Security Volume Activity*