

ABSTRAK
PERBANDINGAN RISIKO, RETURN INVESTASI, DAN
VOLATILITAS HARGA SAHAM SYARIAH PADA
SEKTOR PERTAMBANGAN DAN SEKTOR INDUSTRI
BARANG KONSUMSI DI INDEKS SAHAM SYARIAH
INDONESIA

SIGIT KUSBIYANTORO
17913076

Dalam investasi di pasar modal, terdapat beberapa faktor yang harus dianalisis terlebih dahulu diantaranya yaitu resiko, return serta harga saham. Selain itu, faktor Volatilitas harga saham juga sangat penting untuk dianalisis agar dapat memaksimalkan keuntungan yang diharapkan dan meminimalisir risiko dikemudian hari. Tujuan dari penelitian ini adalah untuk melihat perbedaan return, resiko dan kinerja antara perusahaan saham sektor pertambangan dan sektor industri barang konsumsi serta melihat analisis volatilitas harga saham sektor pertambangan dan sektor industri barang konsumsi.

Berdasarkan alasan tersebut, penelitian ini secara umum bertujuan untuk mendeskripsikan tentang perbandingan. Penelitian ini menggunakan jenis data kuantitatif, bersifat cross section karena berupa harga penutupan saham bulanan dan tahunan perusahaan sektor pertambangan dan sektor industri barang konsumsi yang terdaftar pada Indeks Saham Syariah Indonesia (ISSI) periode 2015-2018. Metode uji beda *independent T-Test* sedangkan untuk melihat volatilitas harga saham perusahaan sektor pertambangan dan sektor industri barang konsumsi dikembangkan model korelasi.

Dari hasil penelitian ini dapat diketahui dan di ambil kesimpulan bahwa Hasil penelitian dengan menggunakan uji beda Mann Whitney menunjukkan resiko perusahaan sektor pertambangan dan sektor industri barang konsumsi didapatkan bahwa terdapat perbedaan signifikan antara resiko perusahaan sektor pertambangan dan sektor industri barang konsumsi. Untuk hasil return investasi sektor pertambangan dan sektor industri barang konsumsi didapatkan hasil bahwa tidak terdapat perbedaan antara return perusahaan sektor pertambangan dan sektor industri barang konsumsi. Sedangkan untuk harga saham sektor

pertambangan dan sektor industri barang konsumsi terdapat perbedaan secara signifikan rata-rata harga saham antara perusahaan sektor pertambangan dan sektor industri barang konsumsi. dari hasil ini peneliti dapat menyimpulkan bahwa volatilitas harga saham perusahaan sektor pertambangan dan sektor industri barang konsumsi di pastikan bahwa volatilitas harga saham perusahaan pertambangan lebih rendah dibandingkan sektor industri barang konsumsi.

Kata kunci: *Risiko, Return, Harga Saham, Sektor Pertambangan, Sektor Industri Barang Konsumsi*