

SKRIPSI
PENGARUH COVID-19, VOLATILITAS HARGA, DAN
LIKUIDITAS SAHAM TERHADAP *RETURN* SAHAM PADA
PERUSAHAAN INDEKS LQ45 YANG TERDAFTAR DI
BURSA EFEK INDONESIA TAHUN 2020



DIAJUKAN OLEH:

NAMA : JOHAN

NIM : 125170259

UNTUK MEMENUHI SEBAGIAN DARI SYARAT-SYARAT
GUNA MENCAPAI GELAR SARJANA EKONOMI

PROGRAM STUDI S1 AKUNTANSI
FAKULTAS EKONOMI & BISNIS
UNIVERSITAS TARUMANAGARA
JAKARTA

2020

UNIVERSITAS TARUMANAGARA
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS
JAKARTA

HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI

NAMA : JOHAN
NIM : 125170259
JURUSAN : S1 / AKUNTANSI
BIDANG KONSENTRASI : AKUNTANSI KEUANGAN MENENGAH
JUDUL SKRIPSI : PENGARUH COVID-19, VOLATILITAS
HARGA, DAN LIKUIDITAS SAHAM
TERHADAP RETURN SAHAM PADA
INDEKS LQ45 YANG TERDAFTAR DI
BURSA EFEK INDONESIA TAHUN 2020

Jakarta, 11 Januari 2021

Dosen Pembimbing,



(Rousilita Suhendah, S.E., M.Si., Ak., CA.)

FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS

UNIVERSITAS TARUMANAGARA

JAKARTA

TANDA PENGESAHAN SKRIPSI

NAMA : JOHAN
NPM : 125170259
PROGRAM STUDI : S1 AKUNTANSI

JUDUL SKRIPSI

PENGARUH COVID-19, VOLATILITAS HARGA, DAN LIKUIDITAS
SAHAM TERHADAP *RETURN* SAHAM PADA PERUSAHAAN INDEKS
LQ45 YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK INDONESIA TAHUN 2020

Telah diuji pada sidang Skripsi pada tanggal 26 Januari 2021 dan dinyatakan lulus
dengan majelis penguji terdiri dari:

1. Ketua : Nurainun Bangun Dra., Ak., M.M.
2. Anggota : Lukman Surjadi Drs., M.M.
Rousilita Suhendah, S.E., M.Si., Ak., CA.

Jakarta, 29 Januari 2021

Pembimbing



Rousilita Suhendah, S.E., M.Si., Ak., CA.

UNIVERSITAS TARUMANAGARA
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS
JAKARTA

ABSTRAK

**PENGARUH COVID-19, VOLATILITAS HARGA, DAN LIKUIDITAS
SAHAM TERHADAP *RETURN* SAHAM PADA PERUSAHAAN INDEKS
LQ45 YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK INDONESIA TAHUN 2020**

Penelitian ini bertujuan untuk memperoleh bukti empiris mengenai pengaruh covid-19, volatilitas harga, dan likuiditas saham terhadap *return* saham perusahaan indeks LQ45 yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia selama tahun 2020 dengan sampel sebanyak 45 perusahaan setelah melalui metode purposive sampling. Penelitian ini menggunakan data sekunder yang kemudian diolah dengan analisis regresi berganda yang dibantu Eviews 11. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa covid-19 berpengaruh negatif signifikan terhadap return saham, sedangkan volatilitas harga dan likuiditas saham berpengaruh positif signifikan terhadap return saham.

Kata kunci: *Return* saham, Covid-19, Volatilitas Harga, Likuiditas Saham

This study aims to obtain empirical evidence on effects of covid-19, price volatility, and stocks liquidity on stocks return of index LQ45 companies listed on the Indonesian Stock Exchange during 2020 period with a sample of 45 companies after going through the method. purposive sampling. This study uses secondary data which was tested using multiple regression analysis helped by Eviews 11 and Microsoft Excel 2016. The results of this study indicate that covid-19 has a significant negative effect on stocks return, while price volatility and stocks liquidity have significant positive effect on stocks return.

Keywords: *Stocks Return, Covid-19, Price Volatility, Stocks Liquidity*