

ABSTRAK

Capital Asset Pricing Model (CAPM) Sebagai Alat analisis untuk mengamati Pengaruh Risiko Pasar terhadap Return Saham Syariah Sebelum dan Selama Pandemi Covid-19.

Oleh :

Hasna Qurratu ‘ Ain Putri

111171152

Penelitian ini bertujuan untuk mengamati pengaruh risiko pasar terhadap return saham syariah sebelum dan selama pandemic Covid-19. Penelitian ini yang menjadi objek penelitian adalah Risiko Pasar terhadap Return Saham Syariah Sebelum dan selama pandemic covid-19. Sementara yang menjadi subjek dalam penelitian ini adalah perusahaan yang terdaftar dalam Indeks Saham Syariah Indonesia. Periode penelitian yang diambil adalah Maret 2019-Maret 2021. Desain penelitian ini adalah penelitian deskriptif kuantitatif. Populasi penelitian ini adalah seluruh saham yang masuk dalam Indeks Saham Syariah Indonesia (ISSI). Teknik pemilihan sampel penelitian ini menggunakan metode *purposive sampling* dan diperoleh sebanyak 97 saham sebagai sampel penelitian. Variabel dalam penelitian ini adalah Risiko Pasar dan Return Saham. Perhitungan *return* menggunakan Capital Asset Pricing Model (CAPM). Teknik Analisis data dalam penelitian ini adalah analisis deskriptif, analisis regresi linear sederhana , analisis two pass regression dan uji asumsi klasik.

Kata Kunci : *Capital Asset Pricing Model, Risiko Pasar , Return Saham Syariah , dan Pandemi Covid 19.*

ABSTRACT

Capital Asset Pricing Model (CAPM) As an analytical tool to observe the effect of market risk on Islamic stock return before and during Covid-19 Pandemic.

By :

Hasna Qurratu' Ain Putri

1111171152

This study aims to see the effect of market risk on Islamic stock returns before and during the Covid-19 pandemic. The object of this research is Market Risk on Syariah Stock Returns before and during the covid-19 pandemic. While the subjects in this study are companies listed on the Indonesian Sharia Stock Index. The research period is March 2019-March 2021. The design of this study is a quantitative descriptive study. The population in this study were 403 companies listed on the Islamic Stock Exchange and the Indonesia Stock Exchange. The sampling technique of this research used purposive sampling method and obtained as many as 97 stocks as the research sample. The variables in this study are Market Risk and Stock Return. The calculation of return used the Capital Asset Pricing Model (CAPM). Data analysis techniques in this study are descriptive analysis, simple linear regression analysis, two-pass regression analysis and classical assumption test.

Keywords : *Capital Asset Pricing Model , Risk market , Syariah Stock Returns and Covid-19 Pandemi*