

ABSTRAK

Kristiana Oktafianti, 2021. *Pengaruh Trading Volume Activity, Dividend Payout Ratio dan Dividend Yield Terhadap Volatilitas Harga Saham Pada Perusahaan yang Terdaftar di ISSI Sektor Industri Barang Konsumsi Tahun 2017-2019*, Skripsi, Program Studi Akuntansi Syariah, Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam, IAIN Madura, Pembimbing: H. Wadhan, SE. M.Si.

Kata Kunci: *Trading Volume Activity, Dividend Payout Ratio, Dividend Yield, Volatilitas Harga Saham*

Penelitian ini bertujuan untuk menguji dan menganalisis bagaimana pengaruh antara *trading volume activity*, *dividend payout ratio* dan *dividend yield* terhadap volatilitas harga saham secara simultan maupun parsial. Populasi yang digunakan dalam penelitian ini yaitu perusahaan sektor industri barang konsumsi yang terdaftar di ISSI tahun 2017-2019 sebanyak 43 perusahaan. Penelitian ini menggunakan pendekatan kuantitatif kausal dengan sumber data yang digunakan merupakan data sekunder berupa laporan keuangan yang bersumber dari www.idx.com. Teknik pengumpulan data dalam penelitian ini menggunakan *purposive sampling*, dan terdapat 23 perusahaan yang memenuhi kriteria sebagai sampel dalam penelitian ini. Sehingga sampel dalam penelitian ini berjumlah 69 sampel selama 3 tahun. Analisis data yang digunakan yaitu mencari data mentah, statistik deskriptif, uji asumsi klasik, dan uji hipotesis dengan bantuan program SPSS versi 20.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa; *pertama*, variabel *trading volume activity* diperoleh nilai t_{hitung} sebesar 0,714 dan nilai t_{tabel} sebesar 2,01954 dengan tingkat signifikan 0,479 yang artinya *trading volume activity* tidak berpengaruh dan tidak signifikan terhadap volatilitas harga saham; *kedua*, variabel *dividend payout ratio* diperoleh nilai t_{hitung} sebesar 0,076 dan nilai t_{tabel} sebesar 2,01954 dengan tingkat signifikan 0,940 yang artinya *dividend payout ratio* tidak berpengaruh dan tidak signifikan terhadap volatilitas harga saham; *ketiga*, variabel *dividend yield* diperoleh nilai t_{hitung} sebesar 0,263 dan nilai t_{tabel} sebesar 2,01954 dengan tingkat signifikan 0,794 yang artinya *dividend yield* tidak berpengaruh dan tidak signifikan terhadap volatilitas harga saham; *keempat*, pada hasil uji F diperoleh nilai F_{hitung} sebesar 0,233 dan nilai F_{tabel} sebesar 2,827 dengan tingkat signifikan 0,873, yang berarti bahwa *trading volume activity*, *dividend payout ratio* dan *dividend yield* secara bersama-sama tidak berpengaruh terhadap volatilitas harga saham.