



## SEMEABB 2018

Prosiding online: <http://semeabb.ijbe-research.com>



# ANALISIS VOLATILITAS INDEKS SAHAM SEKTORAL DI BURSA EFEK INDONESIA

*Abid Djazuli<sup>1</sup>, Ervita Safitri<sup>2</sup>*

<sup>1,2</sup> Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Muhammadiyah Palembang

<sup>1</sup>*ervitasafitri@gmail.com*

<sup>2</sup>*abid\_djazuli@um-palembang.ac.id*

### INFO ARTIKEL

**Sejarah Artikel:**

Diterima : 17-08-2018

Terbit : 25-10-2018

**Kata Kunci:**

Volatilitas

Volatilitas Historis

Volatilitas Model Buescu

Indeks Harga Saham Sektoral

**DOI:**

10.5281/zenodo.1470943

### ABSTRAK

Volatilitas merupakan pengukuran statistik untuk fluktuasi harga aset selama periode waktu tertentu, di mana data yang digunakan bersifat runtut waktu yang acak, dan diukur sebagai standard deviasi. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui apakah model perhitungan volatilitas yang digunakan dapat memberikan hasil yang efisien serta mengetahui pergerakan volatilitas indeks harga saham sektoral di Bursa Efek Indonesia. Jenis penelitian ini adalah penelitian kuantitatif. Populasi penelitian ini adalah indeks harga saham yang ada di Bursa Efek Indonesia periode Januari 2016 – Desember 2017. Dengan teknik *judgment sampling* diperoleh sampel penelitian sebanyak 10 indeks harga saham sektoral. Metode analisis data yang digunakan dalam penelitian ini adalah metode kuantitatif. Hasil penelitian menunjukkan bahwa model perhitungan volatilitas Buescu memberikan hasil yang tidak bias, dan memiliki varians minimum. Pergerakan volatilitas indeks harga saham sektoral di Indonesia menunjukkan *trend* yang menurun pada semua sektor, kecuali pada sektor perdagangan, jasa dan investasi yang menunjukkan garis *trend* yang tetap.



This work is licensed under a Creative Commons Attribution 4.0 International License.