

**ANALISIS PENGARUH VOLUME PERDAGANGAN, DIVIDEND
PAYOUT RATIO, DAN INFLASI TERHADAP VOLATILITAS HARGA
SAHAM PADA PERUSAHAAN MANUFAKTUR YANG TERDAFTAR DI
BEI PERIODE 2013-2017**



FAKULTAS EKONOMI

UNIVERSITAS SATYA NEGARA INDONESIA

2018

**ANALISIS PENGARUH VOLUME PERDAGANGAN, DIVIDEND
PAYOUT RATIO, DAN INFLASI TERHADAP VOLATILITAS HARGA
SAHAM PADA PERUSAHAAN MANUFAKTUR YANG TERDAFTAR DI
BEI PERIODE 2013-2017**

SKRIPSI

Diajukan Sebagai Salah Satu Syarat Untuk Memperoleh Gelar

SARJANA EKONOMI

Program Studi Manajemen – Strata 1



FAKULTAS EKONOMI

UNIVERSITAS SATYA NEGARA INDONESIA

2018

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh volume perdagangan, *dividend payout ratio* (DPR) dan inflasi terhadap volatilitas harga saham pada perusahaan manufaktur yang terdaftar di BEI periode 2013-2017. Populasi dalam penelitian ini adalah seluruh perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2013-2017 sebanyak 152 perusahaan. Sampel ditentukan dengan menggunakan metode *purposive sampling* dengan kriteria-kriteria antara lain perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2013-2017 dan perusahaan manufaktur yang selalu membagikan dividen dari tahun 2013-2017 sehingga diperoleh sampel penelitian sebanyak 32 perusahaan. Sumber data yang digunakan adalah idx.co.id dan bi.go.id. Hasil penelitian menunjukkan bahwa volume perdagangan dan *dividen payout ratio* berpengaruh positif terhadap volatilitas harga saham, sedangkan inflasi tidak berpengaruh terhadap volatilitas harga saham.

Kata kunci: Volatilitas Harga Saham, Volume Perdagangan, *Dividen Payout Ratio*, dan Inflasi



ABSTRACT

This study aims to determine the effect of trading volume, dividend payout ratio (DPR) and inflation on stock price volatility in manufacturing companies listed on the IDX period 2013-2017. The population in this study are all manufacturing companies listed on the Indonesia Stock Exchange period 2013-2017 as many as 152 companies. The sample is determined by using purposive sampling method with criteria such as manufacturing company listed in Indonesia Stock Exchange period 2013-2017 and manufacturing company which always distributed dividend from year 2013-2017 so as to get 32 research sample. Data source used is idx.co.id and bi.go.id. The results showed that trade volume and dividend payout ratio have a positive effect on stock price volatility, while inflation does not affect stock price volatility.

Keywords: Volatility of Stock Price, Trade Volume, Payout Ratio Dividend, and Inflation

