

**PENGARUH VOLUME PERDAGANGAN SAHAM, FREKUENSI
PERDAGANGAN SAHAM, DAN KAPITALISASI PASAR TERHADAP
RETURN SAHAM PADA PERUSAHAAN LQ45 YANG TERDAFTAR DI
BEI PERIODE 2016 -2018**



UNIVERSITAS SATYA NEGARA INDONESIA

FAKULTAS EKONOMI

JAKARTA

2019

**PENGARUH VOLUME PERDAGANGAN SAHAM, FREKUENSI
PERDAGANGAN SAHAM, DAN KAPITALISASI PASAR TERHADAP
RETURN SAHAM PADA PERUSAHAAN LQ45 YANG TERDAFTAR DI
BEI PERIODE 2016 -2018**

SKRIPSI

Diajukan Sebagai Salah Satu Syarat Untuk Memperoleh Gelar

Sarjana Ekonomi

Program Studi Manajemen – Strata 1



OLEH :

NAMA : DHINAR ANGGRAENY

NIM : 041501503125016

**UNIVERSITAS SATYA NEGARA INDONESIA
FAKULTAS EKONOMI
JAKARTA
2019**

ABSTRACT

The purpose of this research is determine how much effect of stock trading volume, stock trading frequency, and market capitalization on Stock Returns on LQ45 companie listed on the Indonesian Stock Exchange for the 2016-2018 period partially or simultaneously. This study uses secondary data obtained from the Indonesia Stock Exchange. The population in this study is LQ45 companies listed on the Indonesia Stock Exchange for the period of 2016-2018. Taking technique This study aims to determine how much influence the stock trading volume, frequency of stock trading, and market capitalization of stock returns on LQ45 companies listed on the Stock Exchange in the 2016-2018 period partially or simultaneously. This study uses secondary data obtained from the Indonesia Stock Exchange. The population in this study is LQ45 companies listed on the Indonesia Stock Exchange for the period of 2016 - 2018. The sampling technique uses purposive sampling.

Based on the results of this study partially shows the volume of stock trading with a significance level of 0.019. frequency of stock trading has an effect on stock returns of 0.008, market capitalization has an effect on stock returns of 0.042. Simultaneously, the volume of stock trading, frequency of stock trading and market capitalization affect stock returns of 0.038.

Keywords: *Stock Return, Trading Volume, Trading Frequency and Market Capitlization.*

ABSTRAK

Tujuan dari penelitian ini untuk mengetahui seberapa besar pengaruh volume perdagangan saham, frekuensi perdagangan saham, dan kapitalisasi pasar terhadap *return* saham pada perusahaan LQ45 yang terdaftar di BEI periode 2016-2018 secara parsial maupun simultan. Penelitian ini menggunakan data sekunder yang diperoleh dari Bursa Efek Indonesia. Populasi dalam penelitian ini adalah perusahaan LQ45 yang terdaftar di BEI periode 2016 – 2018. Teknik pengambilan sampel yang menggunakan *purposive sampling*. Berdasarkan kriteria yang ada, didapatkan 31 perusahaan yang menjadi sampel penelitian. Teknik analisis data yang digunakan adalah analisis regresi linier berganda dengan tingkat signifikansi 0,05.

Berdasarkan hasil penelitian ini menunjukkan secara parsial volume perdagangan saham dengan tingkat signifikansi sebesar 0,019. frekuensi perdagangan saham berpengaruh terhadap *return* saham sebesar 0,008, kapitalisasi pasar berpengaruh terhadap *return* saham sebesar 0,042. Secara simultan, volume perdagangan saham, frekuensi perdagangan saham dan kapitalisasi pasar berpengaruh terhadap *return* saham sebesar 0,038.

Kata kunci: *return* saham, volume perdagangan saham, frekuensi perdagangan saham, dan kapitalisasi pasar.

