



1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar UIN Suska Riau.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin UIN Suska Riau.

ABSTRAK

PENGARUH VOLUME PERDAGANGAN DAN NILAI TUKAR TERHADAP RETURN SAHAM PADA PERUSAHAAN OTOMOTIF YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK INDONESIA PERIODE 2013-2017

Oleh :

RENTYKA SARI
11471202054

Tujuan dalam penelitian ini adalah untuk mengetahui pengaruh volume perdagangan dan nilai tukar terhadap return saham pada perusahaan otomotif yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI). Sampel dalam penelitian ini berjumlah 12 perusahaan otomotif periode 2013 sampai 2016. Dalam penelitian ini menggunakan deskriptif kuantitatif. Analisis dalam penelitian ini menggunakan regresi dengan bantuan evIEWS 9. Berdasarkan hasil penelitian yang telah dilaksanakan dimana nilai probabilitas volume perdagangan yang dihasilkan sebesar $0,023 < 0,05$ maka dapat disimpulkan bahwa volume perdagangan memiliki pengaruh terhadap return saham selain itu nilai tukar dengan nilai probabilitas sebesar $0,041 < 0,05$ maka dapat disimpulkan bahwa nilai tukar memiliki pengaruh terhadap return saham. Secara simultan dimana nilai probabilitas sebesar $0,003$ lebih kecil dari $0,05$ maka volume perdagangan dan nilai tukar memiliki pengaruh terhadap return saham pada perusahaan otomotif yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2013 sampai dengan 2016. Nilai R square sebesar $0,177$ atau sebesar $17,7\%$ volume perdagangan dan nilai tukar dapat mempengaruhi return saham pada perusahaan otomotif yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2013 sampai dengan 2016 sementara sisanya dipengaruhi oleh variabel lainnya.

Kata Kunci : Volume Perdagangan, Nilai Tukar Dan Return Saham

UIN SUSKA RIAU