UIN SUSKA RIAU
Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang
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.
© Hak cipta milik UIN Suska Riau
State Islamic University of Sultan Syarif Kasim Riau

ABSTRAK

PENGARUH VOLUME PERDAGANGAN, *PRICE EARNING RASIO* (PER), *PRICE BOOK VALUE* (PBV), INFLASI DAN SUKU BUNGA TERHADAP *RETURN* SAHAM PADA SEKTOR PERBANKAN DI BURSA EFEK INDONESIA (BEI).

Oleh :

HUSNUL KHOTIMAH
11271206585

Penelitian ini bertujuan untuk menguji pengaruh volume perdagangan, Price Earning Rasio (PER), Price Book Value (PBV), Inflasidan Suku Bunga terhadap Return Saham. *Populasi penelitian ini adalah perusahaan sektor perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia pada tahun 2013-2016. Pemilihan sampel dengan metode purposive sampling. Sampel sebanyak27 perusahaan dengan empat tahun pengamatan. Jenis data adalah data sekunder. Analisis data menggunakan analisis regresi data panel (pool data) menggunakan alat bantu EViews 6.*

Dari hasil penelitian ini menunjukkan bahwa perhitungan hipotesis secara parsial yaitu volume perdagangan berpengaruh signifikan positif terhadap return saham dengan tingkat signifikansi sebesar 0,0192 < 0,05, PER tidak berpengaruh signifikan terhadap return saham hal itu dapat dilihat dengan tingkat signifikansi sebesar 0,6155 > 0,05, PBV berpengaruh signifikan positif terhadap return saham dengan tingkat signifikansi sebesar 0.0000< 0,05, Inflasi berpengaruh signifikan negatif terhadap return saham dengan tingkat signifikansi sebesar 0,0100 < 0,05, dan Suku Bunga berpeng aruh signifikan negatif terhadap return saham dengan tingkat signifikansi sebesar 0.0012 < 0,05, Untuk hasil pengujian secara simultan diperoleh $F_{hitung} > F_{tabel} = 6{,}393725 > 2{,}305$ *berarti hipotesis secara simultan antara volume perdagangan, Price Earning Rasio (PER), Price Book Value (PBV), Inflasi dan Suku Bunga secara bersama-sama berpengaruh terhadap return saham. Dari hasil penelitian ini juga diperoleh Koefisien Determinasi* (R^2) *dengan nilai 0,72,28% atau 72,28% yang berarti bahwa return saham dapat dipengaruhi oleh volume perdagangan, Price Earning Rasio (PER), Price Book Value (PBV), Inflasi dan Suku Bunga sebesar 72,28% sedangkan 27,72% sisanya merupakan varian yang tidak dijelaskan dalam penelitian ini.*

Kata Kunci: *Volume Perdagangan, Price Earning Rasio (PER), Price Book Value (PBV), Inflasi, Suku Bunga dan return saham.*