



**PENGARUH FREKUENSI PERDAGANGAN, VOLUME PERDAGANGAN,
DAN KAPITALISASI PASAR TERHADAP RETURN SAHAM LQ45
DI BURSA EFEK INDONESIA (BEI)**

Oleh :

**ANNUR RASIDAH HARAHAHAP
NIM. 11371206594**

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh frekuensi perdagangan, volume perdagangan, dan kapitalisasi terhadap return saham. Populasi penelitian ini adalah perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode Februari 2014 – agustus 2015. Teknik pengambilan sampel yang digunakan dalam penelitian ini adalah metode purposive sampling. Sampel sebanyak 36 perusahaan dua tahun secara semesteran. Jenis data adalah data sekunder. Analisis data menggunakan uji asumsi klasik dan pengujian hipotesis menggunakan analisis regresi data panel (pooled data) menggunakan alat bantu EViews 6. Hasil penelitian secara parsial menunjukkan bahwa Frekuensi perdagangan berpengaruh negatif dan signifikan terhadap return saham yang ditunjukkan dengan nilai t statistik -2.763280 dan nilai signifikansi 0.0068. Volume perdagangan berpengaruh positif dan signifikan terhadap return saham yang ditunjukkan dengan nilai t statistik 1.673017 dan nilai signifikansi 0.0004. Kapitalisasi pasar berpengaruh negatif dan signifikan terhadap return saham yang ditunjukkan dengan nilai t statistik -11.82275 dan nilai signifikansi 0.0000. Hasil penelitian secara simultan frekuensi perdagangan, volume perdagangan, dan kapitalisasi pasar secara bersama-sama berpengaruh signifikan terhadap return saham yang ditunjukkan dengan nilai F statistik sebesar 3,641678 dengan probabilitas 0.000000. Dari hasil penelitian ini juga diperoleh Koefisien Determinasi (R^2) dengan nilai 0,5685 atau 56,85% yang berarti bahwa return saham dapat dipengaruhi oleh frekuensi perdagangan, volume perdagangan, dan kapitalisasi pasar sebesar 56,85% sedangkan 43,15% sisanya merupakan variabel lain yang tidak dijelaskan dalam penelitian ini.

Kata Kunci : *Frekuensi perdagangan, volume perdagangan, kapitalisasi pasar, return saham*

Hak Cipta Diindungi 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.