

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh volume perdagangan saham, frekuensi perdagangan saham, inflasi dan tingkat suku bunga terhadap *return* saham pada perusahaan perbankan yang terdaftar di BEI periode 2017-2019 secara simultan maupun parsial. Metode pengambilan sampel yang digunakan adalah purposive sampling berdasarkan kriteria tertentu. Sampel yang digunakan dalam penelitian ini adalah 27 perusahaan perbankan yang terdaftar di BEI yang masih aktif diperdagangkan dari tahun 2017 sampai dengan tahun 2019. teknik analisis data menggunakan analisis regresi linier berganda yang didukung dengan uji asumsi klasik yaitu uji normalitas, uji autokorelasi, uji multikolinieritas, dan uji heteroskedastisitas. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa secara simultan volume perdagangan saham, frekuensi perdagangan saham, inflasi, dan tingkat suku bunga bersama-sama berpengaruh signifikan terhadap return saham, sedangkan secara parsial variabel yang berpengaruh adalah variabel tingkat suku bunga.

Kata kunci: volume perdagangan saham, frekuensi perdagangan saham, inflasi, tingkat suku bunga, dan *return* saham

ABSTRACT

This study aims to determine the effect of stock trading volume, stock trading frequency, inflation and interest rates on stock returns in banking companies listed on the IDX for the 2017-2019 period simultaneously or partially. The sampling method used was purposive sampling based on certain criteria. The sample used in this research is 27 banking companies listed on the IDX that are still actively traded from 2017 to 2019. the data analysis technique uses multiple linear regression analysis which is supported by classical assumption tests, namely normality test, autocorrelation test, multicollinearity test, and heteroscedasticity test. The results of this study indicate that simultaneously stock trading volume, stock trading frequency, inflation, and interest rates together have a significant effect on stock returns, while partially the influencing variable is the interest rate variable.

Keywords: stock trading volume, stock trading frequency, inflation, interest rates, and stock returns