

ABSTRAK

Ozy Lahana Avonita. NIM. 1620210120. Pengaruh Frekuensi Perdagangan Saham, Volume Perdagangan Saham dan Kapitalisasi Pasar terhadap *Return* Saham Perusahaan yang Terdaftar di Jakarta Islamic Index Periode 2016-2018.

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh frekuensi perdagangan saham terhadap *return* saham perusahaan yang terdaftar di Jakarta Islamic Index Periode 2016-2018. Untuk mengetahui pengaruh volume perdagangan saham terhadap *return* saham perusahaan yang terdaftar di Jakarta Islamic Index Periode 2016-2018. Untuk mengetahui pengaruh kapitalisasi pasar terhadap *return* saham perusahaan yang terdaftar di Jakarta Islamic Index Periode 2016-2018.

Jenis penelitian yang peneliti gunakan adalah penelitian kepustakaan dengan menggunakan data sekunder. Pendekatan penelitian ini adalah pendekatan kuantitatif. Sampel penelitian ini adalah perusahaan yang terdaftar di Jakarta Islamic Index periode 2016-2018 yang berjumlah 66 responden. Teknik pengumpulan data menggunakan metode dokumentasi. Teknik analisis data yang digunakan adalah analisis statistik deskriptif, uji asumsi klasik, analisis data yang terdiri dari analisis regresi berganda, koefisien determinasi, uji statistik F dan uji t parsial.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa variabel frekuensi perdagangan saham berpengaruh terhadap *return* saham. Variabel volume perdagangan saham tidak berpengaruh terhadap *return* saham. Variabel kapitalisasi pasar berpengaruh terhadap *return* saham.

Kata Kunci : **Frekuensi Perdagangan Saham, Volume Perdagangan Saham, Kapitalisasi Pasar, *Return* Saham.**