

**SKRIPSI**

**PENGARUH VOLUME DAN FREKUENSI  
PERDAGANGAN SAHAM DAN VOLATILITAS  
TERHADAP *RETURN* SAHAM PADA PERUSAHAAN  
OTOMOTIF DAN KOMPONENNYA YANG TERDAFTAR  
DI BURSA EFEK TAHUN 2015 - 2018**



**DIAJUKAN OLEH:**

**NAMA : RINA PUTRI DARYANI**

**NIM : 115160169**

**UNTUK MEMENUHI SEBAGIAN DARI SYARAT-SYARAT  
GUNA MENCAPAI GELAR SARJANA EKONOMI**

**PROGRAM STUDI S1 MANAJEMEN**

**FAKULTAS EKONOMI**

**UNIVERSITAS TARUMANAGARA**

**JAKARTA**

**2020**

UNIVERSITAS TARUMANAGARA

FAKULTAS EKONOMI


JAKARTA

HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI

NAMA : RINA PUTRI DARYANI  
NO. MAHASISWA : 115160169  
PROGRAM / JURUSAN : S1 / MANAJEMEN  
BIDANG KONSENTRASI : MANAJEMEN KEUANGAN  
JUDUL SKRIPSI : PENGARUH VOLUME DAN FREKUENSI  
PERDAGANGAN SAHAM DAN  
VOLATILITAS TERHADAP *RETURN*  
SAHAM PADA PERUSAHAAN OTOMOTIF  
DAN KOMPONENNYA YANG  
TERDAFTAR DI BURSA EFEK TAHUN  
2015-2018

Jakarta, 10 Februari 2020

Pembimbing,

  
Dr. Sarwo Edy Handoyo, S.E., M.M.

FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS  
UNIVERSITAS TARUMANAGARA  
JAKARTA

TANDA PENGESAHAN SKRIPSI

Nama : Rina Putri Daryani  
NIM : 115160169  
Program Studi : Manajemen

**Judul Skripsi**

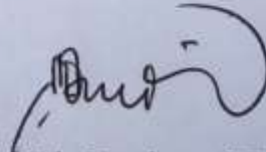
Pengaruh Volume dan Frekuensi Perdagangan Saham dan Volatilitas terhadap *Return* Saham pada Perusahaan Otomotif dan Komponennya yang terdaftar di Bursa Efek tahun 2015-2018.

Telah diuji pada Ujian Skripsi dan Komprehensif tanggal 29 Januari 2020 dan dinyatakan lulus, dengan tim penguji yang terdiri atas:

1. Ketua : Dr. Nuryasman M.N, S.E., M.M.
2. Anggota : Drs. Maswar Abdi, M.E.
3. Anggota : Dr. Sarwo Edy Handoyo, S.E., M.M.

Jakarta, 5 Februari 2020

Pembimbing



(Dr. Sarwo Edy Handoyo, S.E., M.M.)

## ABSTRAK

UNIVERSITAS TARUMANAGARA

FAKULTAS EKONOMI

JAKARTA

(A) RINA PUTRI DARYANI (115160169)

(B) PENGARUH VOLUME DAN FREKUENSI PERDAGANGAN SAHAM DAN VOLATILITAS TERHADAP RETURN SAHAM PADA PERUSAHAAN OTOMOTIF DAN KOMPONENNYA YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK TAHUN 2015 - 2018

(C) xi + 76 halaman, 2020, tabel 13, gambar 1, lampiran 1

(D) MANAJEMEN KEUANGAN

(E) Abstrak: Tujuan penelitian ini adalah untuk mengetahui secara kausal pengaruh *stock trading voume*, *stock trading frequency*, dan *volatility* terhadap *stock return* pada perusahaan otomotif dan komponennya yang terdaftar di BEI tahun 2015-2018. Populasi penelitian ini adalah seluruh perusahaan yang terdaftar di BEI sub-sektor otomotif dan komponennya. Teknik pengambilan sampel yang digunakan adalah *purposive sampling*. Sampel yang digunakan sebanyak tujuh perusahaan yang telah lolos dari persyaratan sampel. Jenis data yang digunakan adalah data panel dan menggunakan analisis regresi berganda. Program yang digunakan adalah *evIEWS 9*. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa *stock trading volume* berpengaruh positif dan signifikan terhadap *stock return*. *Stock trading frequency* berpengaruh negatif namun signifikan. *Volatility* berpengaruh positif dan signifikan. Implikasi dari penelitian ini membuktikan bahwa *stock trading volume*, *stock trading frequency*, dan *volatility* berpengaruh secara simultan terhadap *stock return*.

(F) Abstract: The purpose of this study was to know causally the effect of *stock trading volume*, *stock trading frequency*, and *volatility* on *stock return* of automotive companies and it's component that listed in Indonesian Stock Exchange in 2015-2018. The population of this study were all companies that listed in Indonesian Stock Exchange of automotive companies and it's component sub-sector. The sampling technique used was *purposive sampling* with seven samples that have passed the requirements. Panel data was used in this research and used simultan analysis regression. The program that used was *evIEWS 9*. The results of this study indicate that *stock trading volume* does positively and significantly influence the *stock return*. *Stock trading frequency* has negative result but has a significant effect on *stock return*. *Volatility* has positive result and

*significantly influence the stock return. The implications of this study prove that stock trading volume, stock trading frequency, and volatility simultaneously have a significant effect on stock return.*

(G) Daftar Acuan 61 (1978-2019)

(H) Dr. Sarwo Edy Handoyo, S. E., M. M.