

**PENGARUH FREKUENSI PERDAGANGAN, VOLUME  
PERDAGANGAN, KAPITALISASI PASAR DAN VOLATILITAS HARGA  
SAHAM TERHADAP *RETURN* SAHAM PADA PERUSAHAAN  
*PROPERTY* DAN *REAL ESTATE* YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK  
INDONESIA PERIODE 2013-2017**

Rafiardi Fakhiratama

NIM: 141150328

rafiardifakhiratama@gmail.com

Mahasiswa Program Studi Manajemen

Fakultas Ekonomi dan Bisnis UPN “Veteran” Yogyakarta

**ABSTRAK**

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh frekuensi perdagangan, volume perdagangan, kapitalisasi pasar dan volatilitas harga saham terhadap *return* saham pada perusahaan *property* dan *real estate* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2013-2017. Sampel dalam penelitian ini berjumlah 150 sampel data perusahaan *property* dan *real estate*. Alat analisis yang digunakan adalah model regresi berganda. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa frekuensi perdagangan, volume perdagangan, kapitalisasi pasar dan volatilitas harga saham berpengaruh secara simultan terhadap *return* saham. Frekuensi perdagangan berpengaruh negatif dan signifikan terhadap *return* saham. Volume perdagangan berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham. Kapitalisasi pasar berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham. Dan volatilitas harga saham tidak berpengaruh terhadap *return* saham.

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