

**PENGARUH FREKUENSI PERDAGANGAN,
VOLUME PERDAGANGAN, DAN KAPITALISASI PASAR TERHADAP
RETURN SAHAM PERUSAHAAN KEUANGAN YANG
TERDAFTAR PADA BURSA EFEK INDONESIA PERIODE 2020-2022**

Nurakhmad Waskitho
naworkspace@outlook.com

Abstrak

Tujuan penelitian ini adalah untuk menguji pengaruh frekuensi perdagangan, volume perdagangan, dan kapitalisasi pasar terhadap *return* saham perusahaan keuangan yang terdaftar pada Bursa Efek Indonesia periode 2020-2022. Fenomena yang menjadi fokus utama dalam penelitian ini adalah *return* harga saham perusahaan keuangan yang terdaftar pada Bursa Efek Indonesia dalam kurun waktu 3 tahun terakhir selama krisis ekonomi dan kesehatan global yang terjadi di Indonesia. Populasi dalam penelitian ini berjumlah 98 perusahaan. Teknik pengambilan sampel menggunakan metode *purposive sampling* sehingga memperoleh 95 sampel perusahaan dengan total amatan dalam penelitian ini berjumlah 285. Teknik analisis dalam penelitian ini menggunakan metode analisis Regresi Berganda dan dilakukan pengujian asumsi klasik terlebih dahulu sehingga memenuhi kriteria BLUE (*Best, Linear, Unbiased, and Estimated*). Hasil analisis dalam penelitian ini menunjukkan bahwa: frekuensi perdagangan, volume perdagangan, dan kapitalisasi pasar secara bersama-sama berpengaruh terhadap *return* saham. frekuensi perdagangan berpengaruh negatif dan signifikan terhadap *return* saham, volume perdagangan berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham, dan kapitalisasi pasar berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham.

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