

**PENGARUH FREKUENSI PERDAGANGAN, VOLUME PERDAGANGAN,
DAN KAPITALISASI PASAR TERHADAP *RETURN* SAHAM SEKTOR
PERTAMBANGAN BATUBARA DI BURSA EFEK INDONESIA**

MUHAMMAD GARINDIRA RAHJAYA

NIM. 141200136

Mahasiswa Program Studi Manajemen

Fakultas Ekonomi dan Bisnis UPN “Veteran” Yogyakarta

Email: garindiira@gmail.com

Dosen Pembimbing:

Drs. Didit Herlianto, M.Si.

Email: diditgatra@yahoo.co.id

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengeksplorasi pengaruh frekuensi perdagangan, volume perdagangan, dan kapitalisasi pasar terhadap *return* saham di sektor pertambangan batubara di Bursa Efek Indonesia (BEI) selama periode 2020-2022. Data yang digunakan bersifat sekunder dan diambil dari IDX Annually Statistics selama rentang waktu tersebut. Menggunakan metode purposive sampling, penelitian melibatkan 18 perusahaan tambang batubara yang terdaftar di BEI. Analisis dilakukan melalui regresi berganda, pengujian asumsi klasik, serta uji hipotesis (uji F dan uji t) dan uji koefisien determinasi. Hasilnya menunjukkan bahwa secara bersama-sama, frekuensi perdagangan, volume perdagangan, dan kapitalisasi pasar memiliki pengaruh yang signifikan terhadap *return* saham. Secara parsial, volume perdagangan dan kapitalisasi pasar menunjukkan pengaruh signifikan terhadap *return* saham, sementara frekuensi perdagangan tidak menunjukkan pengaruh yang signifikan.

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