

ABSTRAK

Pasar modal mempunyai peranan penting dalam perekonomian suatu negara yang dapat memutar perekonomian suatu negara agar tetap tumbuh dan berkembang. Di Bursa Efek Indonesia pada pasar modal dengan indeks LQ45 terdapat likuiditas yang tinggi, seleksi atas emiten-emiten dan mempertimbangkan kapitalisasi pasar. Seiring berkembangnya perekonomian dan teknologi maka diperlukan perusahaan yang aktif diperdagangkan dengan memiliki strategi manajemen yang efisien agar dapat mempertahankan tingkat *return* saham.

Penelitian ini bertujuan untuk seberapa besar pengaruh Frekuensi Perdagangan Saham, Volume Perdagangan Saham dan Kapitalisasi Pasar terhadap *Return* Saham pada Indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia periode 2013-2017 secara parsial atau simultan. Data diperoleh dari Bursa Efek Indonesia dengan 45 emiten dengan kriteria *purposive* and *sampling* yang telah didapatkan 24 perusahaan yang dijadikan sampel. Penelitian ini menggunakan metode kuantitatif dengan penggunaan data sekunder periode 2013-2017.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa secara parsial variabel frekuensi perdagangan dan kapitalisasi pasar terbukti berpengaruh signifikan terhadap *return* saham, sedangkan variabel volume perdagangan terbukti tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham. Secara simultan variabel Frekuensi Perdagangan Saham, Volume Perdagangan Saham, dan Kapitalisasi Pasar berpengaruh signifikan terhadap *return* saham pada perusahaan LQ45 di bursa efek indonesia 2013-2017.

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