

## **ABSTRAK**

Jaya Husman Perdana, 15101155310605, Manajemen, 2019. Pengaruh Frekuensi Perdagangan, Volume Perdagangan, Kapitalisasi Pasar dan Earning Per Share (EPS) terhadap Return Saham Sub Sektor Property dan Real Estate Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Periode 2014-2017. Dibawah bimbingan Bapak Mondra Neldi, S.E, M.M dan Bapak Ronni Andri Wijaya, S.E, M.M.

Penelitian ini bertujuan untuk membuktikan pengaruh Frekuensi Perdagangan, Volume Perdagangan, Kapitalisasi Pasar dan Earning Per Share secara parsial terhadap Return Saham pada perusahaan Property dan Real Estate yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Periode yang digunakan dalam penelitian ini adalah 4 tahun, mulai dari 2014 sampai dengan 2017. Penelitian ini menggunakan data sekunder yang diperoleh dari Bursa Efek Indonesia. Teknik sampel pada penelitian ini menggunakan purposive sampling. Jumlah sampel yang diperoleh sebanyak 30 perusahaan. Metode analisis penelitian ini menggunakan analisis regresi linier berganda.

Dari penelitian ini diperoleh hasil sebagai berikut : variable frekuensi perdagangan berpengaruh negatif dan signifikan terhadap return saham, variabel volume perdagangan berpengaruh positif dan signifikan terhadap return, variabel kapitalisasi pasar dan earning per share tidak berpengaruh positif dan tidak signifikan terhadap return saham.

Kata kunci : return saham, frekuensi perdagangan, volume perdagangan, kapitalisasi pasar, earning per share