

## ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui Pengaruh Volume Perdagangan Saham, *Size*, *Book to Market Ratio*, Terhadap *Return* Saham pada Perusahaan Manufaktur Sektor Industri Barang Konsumsi yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia tahun 2015-2019. Data yang digunakan adalah data sekunder yang diperoleh dari laporan tahunan dari 2015-2019 melalui situs Bursa Efek Indonesia.

Penelitian ini dilakukan pada Perusahaan Manufaktur Sektor Industri Barang Konsumsi Yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2015-2019. Pemilihan sampel sejumlah 175 data dari 35 perusahaan dengan menggunakan metode *purposive sampling*. Penelitian ini menggunakan analisis deskriptif. Data pada penelitian dianalisis dengan Teknik Regresi Panel. Pengolahan data penelitian menggunakan *software Econometrik Views* (Eviews) versi 10.

Hasil penelitian menunjukkan secara parsial volume perdagangan saham berpengaruh signifikan terhadap *return* saham, *size* tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham, *book to market ratio* berpengaruh signifikan terhadap *return* saham. volume perdagangan saham, *size* dan *book to market ratio* secara simultan berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham.

**Kata Kunci :** **Volume Perdagangan Saham, *Size*, *Book to Market Ratio*, *Return* Saham**