

ABSTRAK

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui pengaruh frekuensi perdagangan, volume perdagangan dan kapitalisasi pasar terhadap *return* saham pada perusahaan manufaktur sektor barang konsumsi yang terdaftar di bursa efek indonesia periode 2014-2018. Analisa data dalam penelitian ini menggunakan statistic deskriptif, regresi data panel, analisis regresi linear berganda, uji F, uji t dan R^2 . Adapun keseluruhan analisis data ini menggunakan bantuan komputer dengan software program eviews 9 for windows. Hasil penelitian ini menyimpulkan bahwa: (1) frekuensi perdagangan tidak berpengaruh terhadap *return* saham. (2) volume perdagangan tidak berpengaruh terhadap *return* saham. (3) kapitalisasi pasar berpengaruh terhadap *return* saham. (4) frekuensi perdagangan, volume perdagangan dan kapitalisasi pasar secara bersama-sama tidak berpengaruh terhadap *return* saham.

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