

PENGARUH VOLUME PERDAGANGAN SAHAM, LABA AKUNTANSI, ARUS KAS PENDANAAN, DAN UKURAN PERUSAHAAN TERHADAP RETURN SAHAM PERUSAHAAN LQ-45 DI BURSA EFEK INDONESIA

Oleh :

Nida Ankhofia

NIM : 190610132

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk membuktikan pengaruh Volume Perdagangan Saham, Laba Akuntansi, Arus Kas Pendanaan, dan Ukuran Perusahaan secara parsial terhadap Return Saham pada perusahaan LQ-45 yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Dalam penelitian ini menggunakan 4 periode yaitu dari tahun 2018 sampai dengan 2021. Data yang digunakan dalam penelitian ini yaitu data sekunder yang diperoleh dari laporan keuangan tahunan perusahaan dalam *Indonesian Stock Exchange* (IDX). Jenis penelitian ini adalah penelitian kuantitatif deskriptif. Populasi dalam penelitian ini meliputi perusahaan LQ-45 yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2018-2021. Teknik pengambilan sampel yang digunakan adalah *purposive sampling* dan memperoleh data penelitian sebanyak 22 perusahaan yang menjadi sampel penelitian. Teknik analisis data yang digunakan yaitu statistik deskriptif, uji asumsi klasik, dan uji regresi linear berganda. Berdasarkan pengujian hipotesis dengan menggunakan uji t, disimpulkan Volume Perdagangan Saham berpengaruh positif dan signifikan terhadap return saham. Laba Akuntansi tidak berpengaruh terhadap return saham. Arus Kas Pendanaan tidak berpengaruh terhadap return saham. Ukuran Perusahaan tidak berpengaruh terhadap return saham.

Kata Kunci : Return Saham, Volume Perdagangan Saham, Laba Akuntansi, Arus Kas Pendanaan, Ukuran Perusahaan

EFFECT OF STOCK TRADE VOLUME, ACCOUNTING PROFIT, FUNDING CASH FLOW, AND COMPANY SIZE ON LQ-45 COMPANY SHARE RETURN ON THE INDONESIA STOCK EXCHANGE

By :

Nida Ankhofia

NIM : 190610132

ABSTRACT

This study aims to partially prove the effect of Stock Trading Volume, Accounting Profit, Funding Cash Flow, and Firm Size on Stock Return on LQ-45 companies listed on the Indonesia Stock Exchange. This study uses 4 periods, namely from 2018 to 2021. The data used in this study is secondary data obtained from the company's annual financial statements in the Indonesian Stock Exchange (IDX). This type of research is descriptive quantitative research. The population in this study includes LQ-45 companies listed on the Indonesia Stock Exchange for the period 2018-2021. The sampling technique used was purposive sampling and obtained research data as many as 22 companies that became the research sample. Data analysis techniques used are descriptive statistics, classical assumption test, and multiple linear regression. Based on hypothesis testing using the t test, it is concluded that stock trading volume has a positive and significant effect on stock returns. Accounting profit has no effect on stock returns. Funding Cash Flow has no effect on stock returns. Company size has no effect on stock returns.

Keywords: *Stock Return, Stock Trading Volume, Accounting Profit, Funding Cash Flow, Company Size*