

## ABSTRAK

**Imelda D. Aliwu, Nim 931 409 092. 2013.** “Pengaruh Volume Perdagangan Terhadap *Return* Saham Pada Perusahaan Sektor Properti Yang Listed Di Bursa Efek Indonesia”. Skripsi. Program Studi Sarjana Manajemen Jurusan Manajemen, Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Negeri Gorontalo. Dibawah bimbingan Bapak Supardi Nani S.pd, M.Si selaku pembimbing I dan Bapak Moh. Agussalim Monoarfa, SE., MM selaku pembimbing II.

Penelitian ini didasarkan pada rumusan masalah apakah volume perdagangan berpengaruh terhadap *return* saham pada perusahaan sektor properti yang listed di Bursa Efek Indonesia. Adapun tujuan dari penelitian ini yaitu untuk menganalisis pengaruh volume perdagangan saham terhadap *return* saham sektor properti yang *listed* di Bursa Efek Indonesia. Metode yang digunakan dalam penelitian ini adalah metode kuantitatif. Metode ini digunakan untuk meramalkan pengaruh antara variabel yang satu dengan variabel yang lain. Dalam penelitian ini yaitu variabel X (*Volume Perdagangan*) merupakan variabel *dependen* (bebas) dan variabel Y (*Return Saham*) merupakan variabel *independen* (terikat). Instrumen yang digunakan adalah data sekunder serta untuk menganalisis data digunakan analisis regresi sederhana. Populasi dalam penelitian ini adalah perusahaan yang *go public* di sektor properti yang *listed* di Bursa Efek Indonesia (BEI) selama periode penelitian yaitu 2008 sampai 2012 sebanyak 10 (sepuluh) perusahaan. Teknik pengambilan sampel yang dilakukan melalui metode *purposive sampling* dengan tujuan untuk mendapatkan sampel yang sesuai dengan tujuan penelitian. Selama periode pengamatan menunjukkan bahwa data penelitian berdistribusi normal, hal ini menunjukkan bahwa data yang tersedia telah memenuhi syarat untuk menggunakan model persamaan regresi linier sederhana.

Berdasarkan hasil penelitian melalui perhitungan SPSS diperoleh persamaan regresi linier sederhana dimana  $\hat{Y} = 0,209 + 0,082$ . Nilai diketahui  $t_{hitung}$  dari variabel independen akan dibandingkan dengan nilai  $t_{tabel}$  dengan menggunakan tingkat kepercayaan (*confidence interval*) 95% atau  $\alpha = 0,05$  sehingga diperoleh nilai  $t_{tabel}$  sebesar 2,009. Nilai  $t_{hitung} 17,797 > t_{tabel} 2,009$ . Sehingga  $H_0$  diterima dan  $H_1$  ditolak. Melalui hasil estimasi model persamaan regresi yang telah dilakukan, diperoleh nilai koefisien determinasi (*R Square*) sebesar 0,868 atau 86,8%. Sedangkan sisanya sebesar 13,2% dijelaskan oleh variabel lainnya yang tidak termasuk dalam penelitian ini.

**Kata Kunci : Volume Perdagangan, Return Saham.**