

ABSTRAK

Ranu Tedja

Skripsi

Pengaruh Volume, Frekuensi Perdagangan dan *Interest Rate* Terhadap

Volatilitas Harga Saham Sektor Properti *Board* LQ45 di BEI Periode 2016

Penelitian ini bertujuan untuk memastikan apakah pergerakan (volatilitas) harga saham dipengaruhi oleh beberapa faktor teknikal seperti volume, frekuensi, maupun *interest rate*.

Populasi pada penelitian ini adalah seluruh perusahaan yang tercatat pada Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2016 dalam *board* LQ45. Sampel yang diambil adalah seluruh perusahaan properti yang tercatat dalam *board* LQ45 sebanyak 10 perusahaan.

Hipotesis penulis menduga bahwa terdapat variabel-variabel teknikal yang dapat mempengaruhi pergerakan atau volatilitas harga saham. Hal ini terbukti pada variabel volume perdagangan dalam uji regresi memperoleh nilai signifikansi sebesar 0,032 dan memiliki rasio terbesar dalam pengaruhnya terhadap volatilitas yang ditunjukkan dalam t hitung sebesar -2,190.

Dari penelitian didapati hanya variabel volume perdagangan saja yang berpengaruh signifikan dan mengambil porsi terbesar dalam mempengaruhi tingkat volatilitas atau pergerakan saham selain itu variabel yang lain tidak ditemukan adanya indikasi berpengaruh terhadap volatilitas harga saham. Dengan uji F ditemukan bahwa ke tiga variabel tersebut hanya mempengaruhi sebesar 7,3% terhadap volatilitas harga saham secara bersamaan.

Kata kunci: Volume Perdagangan, Frekuensi Perdagangan, *Interest Rate*, Volatilitas Harga Saham

ABSTRACT

Ranu Tedja

Thesis

Effect of Volume, Frequency of Trade, and Interest Rate Against. Stock Price Volatility on Property Sector Board LQ45 in BEI Period 2016.

Stock prices are influenced by several technical factors such as volume, frequency, and interest rate.

The population in this study are all companies listed on Indonesia Stock Exchange (BEI) period 2016 in board LQ45. Samples taken are all property companies listed on LQ45 board as many as 10 companies.

The hypothesis authors suspect that there are technical variables that can affect the movement or volatility of stock prices. This is evident in trading volume variables in the regression test obtained a significance value of 0.032 and has the largest ratio in effect on the volatility shown in t arithmetic of -2.190.

From the research it found that only trade volume variables have a significant effect and take the largest portion in affecting the level of volatility or movement of shares price other than other variables are not found any indication effect on stock price volatility. With the F test found that the three variables only affect 7.3% against the volatility of stock prices simultaneously.

Keywords: Stocks, Volume, Frequencies, Interest Rate, Price Volatility