

ABSTRAK

Fakultas Ekonomi dan Bisnis
Program Studi S-1 Manajemen
2022

Anggi Purwanti

1202018289

“Pengaruh Frekuensi Perdagangan, Ukuran Perusahaan, Kepemilikan Institusional, dan Momentum Terhadap Return Saham Serta Tinjauannya Dari Sudut Pandang Islam (Studi Pada Perusahaan Yang Terdaftar Pada Indeks LQ45 Di Bursa Efek Indonesia 2016-2020)”

125 + XVI halaman, 14 tabel, 5 gambar, dan 5 lampiran

Uraian Abstrak

Penelitian ini dilakukan bertujuan untuk menganalisis pengaruh Frekuensi Perdagangan, Ukuran Perusahaan, Kepemilikan Institusional, dan Momentum terhadap *Return* Saham pada perusahaan yang terdaftar pada Indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia periode 2016-2020. Penelitian ini menggunakan metode penelitian kuantitatif dengan jenis data yang digunakan yaitu data sekunder. Sampel yang digunakan sebanyak 27 perusahaan dengan periode 2016- 2020 melalui metode *purposive sampling*. Metode analisis yang digunakan adalah regresi data panel dengan bantuan program *Eviews 9* dan tingkat signifikansi 5 persen. Berdasarkan hasil penelitian disimpulkan bahwa variabel Frekuensi Perdagangan dan Kepemilikan Institusional berpengaruh negatif dan tidak signifikan terhadap *Return* Saham. Sedangkan variabel Ukuran Perusahaan dan Momentum berpengaruh positif dan signifikan terhadap *Return* Saham. Selanjutnya secara simultan bahwa variabel Frekuensi Perdagangan, Ukuran Perusahaan, Kepemilikan Institusional, dan Momentum berpengaruh signifikan terhadap *Return* Saham. Ditinjau dari sudut pandang islam bahwa Frekuensi Perdagangan, Ukuran Perusahaan, Kepemilikan Institusional, Momentum, dan *Return* Saham perusahaan yang terdaftar pada Indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia sudah menerapkan prinsip Islam. Keuntungan yang diperoleh atas investasi yang dilakukan harus sesuai dengan akad yang telah disepakati. Transaksi jual beli yang sesuai dengan syariat Islam adalah transaksi jual beli suka sama suka, tidak adanya bentuk paksaan dari pihak manapun.

Kata Kunci : Frekuensi Perdagangan, Ukuran Perusahaan, Kepemilikan Institusional, Momentum, dan *Return* Saham.

ABSTRACT

**Faculty of Economics and Business
S-1 Management Study Program
2022**

Anggi Purwanti
1202018289

“The Effect of Trading Frequency, Firm Size, Institutional Ownership, and Momentum on Stock Returns and Their Review from an Islamic Perspective (Study on Companies Listed on the LQ45 Index on the Indonesia Stock Exchange 2016-2020)”

125 + XVI pages, 14 tables, 5 pictures, and 5 attachments

Abstract Description

This study aims to analyze the effect of Trading Frequency, Firm Size, Institutional Ownership, and Momentum on Stock Returns in companies listed on the LQ45 Index on the Indonesia Stock Exchange for the 2016-2020 period. This study uses quantitative research methods with the type of data used is secondary data. The sample used was 27 companies with a period 2016-2020 through purposive sampling method. The analysis method of this research using panel data regression with the Eviews 9 program and a significance level of 5 percent. Based on the results of the study, it was concluded that the variables of Trading Frequency and Institutional Ownership had a negative and insignificant effect on Stock Return. While the variables of Firm Size and Momentum have a positive and significant effect on Stock Return. Furthermore, simultaneously that the variables of Trading Frequency, Firm Size, Institutional Ownership, and Momentum have a significant effect on Stock Return. From an Islamic point of view, the Trading Frequency, Company Size, Institutional Ownership, Momentum, and Stock Return of companies listed on the LQ45 Index on the Indonesia Stock Exchange have implemented Islamic principles. The profit earned on the investment made must be in accordance with the agreed contract. Buying and selling transactions in accordance with Islamic law are consensual buying and selling transactions, without any form of coercion from any party.

Keywords : *Trading Frequency, Company Size, Institutional Ownership, Momentum, and Stock Return.*