

ABSTRAK

Elya Nur Awaliyah Fadhillah Fatimah Priatna (1209230059) :
Pengaruh *Market Capitalization*, *Trading Volume* dan *Stock Price* terhadap *Return Saham* pada Perusahaan yang terdaftar di Indeks Saham Syariah Indonesia (ISSI) (Studi Perusahaan PT. Supra Boga Lestari Tbk Periode 2012-2022)

Penelitian ini dilatar belakangi oleh Indonesia merupakan salah satu negara yang tengah berkembang baik dari segi teknologi, pendidikan ataupun ekonomi, hal ini menjadikan Indonesia sebagai sasaran bagi para penanam modal baik itu penanam modal asing ataupun penanam modal dalam negeri dalam menginvestasikan sejumlah uang yang diberikan para pemodal untuk membiayai usaha. Peneliti menduga bahwa adanya pengaruh *Market Capitalization*, *Trading Volume* dan *Stock Price* terhadap *Return Saham*. Selain itu, adanya perbedaan-perbedaan hasil penelitian yang telah dilakukan sebelumnya.

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengidentifikasi Pengaruh *Market Capitalization* secara parsial terhadap *Return Saham*, Pengaruh *Trading Volume* secara parsial terhadap *Return Saham*, Pengaruh *Stock Price* secara parsial terhadap *Return Saham* dan Pengaruh *Market Capitalization*, *Trading Volume*, *Stock Price* secara simultan terhadap *Return Saham* di PT. Supra Boga Lestari Tbk, Periode 2012-2022.

Metode yang digunakan pada penelitian ini adalah metode deskriptif dengan pendekatan kuantitatif. Data yang digunakan berasal dari laporan keuangan tahunan PT. Supra Boga Lestari Tbk Periode 2012-2022. Analisis yang digunakan adalah Uji Asumsi Klasik, Analisis Deskriptif, Analisis Regresi Linier (sederhana dan berganda), Analisis Korelasi *Pearson Product Moment* (PPM), Analisis Koefisien Determinasi, dan Analisis Hipotesis (Uji T dan Uji F). Adapun pengolahan data menggunakan *SPSS For Windows Version 26.0*.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa *Market Capitalization* secara parsial tidak berpengaruh signifikan terhadap *Return Saham* dengan koefisien determinasi sebesar 2% dan t_{hitung} sebesar -0,432. *Trading Volume* secara parsial tidak berpengaruh signifikan terhadap *Return Saham* dengan koefisien determinasi sebesar 0,7% dan t_{hitung} sebesar -0,252. Sedangkan *Stock Price* secara parsial berpengaruh signifikan terhadap *Return Saham* koefisien determinasi sebesar 84,5% dan t_{hitung} sebesar 7.000. pada hal yang sama *Market Capitalization*, *Trading Volume* dan *Stock Price* berpengaruh simultan secara signifikan terhadap *Return Saham* yakni koefisien determinasi 95,4% dan sisanya sebesar 4,6% dan F_{hitung} sebesar 47,970.

Kata Kunci : *Market Capitalization*, *Trading Volume*, *Stock Price*, *Return Saham*