

**PENGARUH RASIO KEUANGAN, NILAI TUKAR RUPIAH DAN
VOLUME PERDAGANGAN TERHADAP *RETURN* SAHAM PADA
PERUSAHAAN PERBANKAN YANG TERDAFTAR
DI BURSA EFEK INDONESIA**

Abstrak

Return saham merupakan salah satu indikator yang dijadikan suatu pertimbangan bagi investor dalam melakukan investasi di Bursa Efek Indonesia. Perusahaan perbankan merupakan salah satu sektor primer pada berbagai saham di Bursa Efek Indonesia yang mempunyai potensi menghasilkan return saham bagi para pemegang sahamnya. Tujuan penelitian ini adalah untuk mengetahui pengaruh rasio keuangan, nilai tukar rupiah dan volume perdagangan terhadap return saham pada perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia.

Penelitian ini menggunakan metode penelitian kuantitatif. Lokasi penelitian dilakukan di situs resmi Bursa Efek Indonesia (BEI) yaitu www.idx.co.id. Objek dalam penelitian ini adalah *Return* Saham, Rasio Keuangan, Nilai Tukar Rupiah dan Volume Perdagangan pada laporan keuangan perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) pada tahun 2019-2021. Populasi dalam penelitian ini adalah seluruh perusahaan perbankan yang berjumlah 46 bank terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) secara berturut-turut periode 2019-2021. Teknik pengambilan sampel dalam penelitian ini adalah menggunakan teknik *purposive sampling* diperoleh sebanyak 38 perusahaan dengan periode sebanyak 3 tahun sehingga diperoleh sebanyak 114 data penelitian. Teknik analisis data yang digunakan dalam penelitian ini adalah analisis regresi linier berganda, analisis korelasi berganda dan uji t.

Berdasarkan hasil pengujian hipotesis yang dilakukan diperoleh hasil bahwa rasio keuangan (ROA) tidak berpengaruh terhadap return saham. Nilai tukar rupiah (kurs) tidak berpengaruh terhadap return saham. volume perdagangan berpengaruh positif terhadap return saham.

Kata Kunci: Rasio Keuangan, Nilai Tukar Rupiah, Volume Perdagangan, Return Saham