

ABSTRAK

Kemajuan suatu negara dapat dilihat dari perkembangan pasar modal, karena pasar modal memegang peranan penting dalam mentransformasikan dan memajukan perekonomian suatu negara agar tumbuh dan berkembang. Bursa Efek Indonesia (BEI) merupakan tempat transaksi perdagangan saham atau pasar modal untuk berbagai jenis usaha di Indonesia.

Pada tahun 2020, pasar saham Indonesia dan global mengalami kehancuran. Hal ini disebabkan oleh terputusnya rantai perekonomian akibat pandemi Covid-19. Namun, saham pada sektor keuangan hanya mengalami sedikit penurunan di akhir tahun 2020, hal tersebut menjadi tolak ukur bahwa sektor keuangan mampu meningkatkan kinerja dengan sangat cepat dan baik dalam pemulihan ekonomi.

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui permasalahan Frekuensi Perdagangan, *Trading Volume Activity*, Nilai Kapitalisasi, dan Harga Saham terhadap *Return* Saham pada Perusahaan Perbankan dalam Indeks LQ45 periode Juli 2022 – Januari 2023 pada masa Pandemi di Bursa Efek Indonesia (BEI) dan Untuk mengetahui Frekuensi Perdagangan, *Trading Volume Activity*, Nilai Kapitalisasi, dan Harga Saham berpengaruh signifikan secara simultan dan parsial terhadap *Return* Saham pada Perusahaan Perbankan dalam Indeks LQ45 periode Juli 2022 – Januari 2023 pada masa Pandemi di Bursa Efek Indonesia (BEI).

Data yang digunakan yaitu data sekunder dengan data dari tujuh perusahaan perbankan yang dihitung kasus pertama Covid-19 pada Maret 2020 - Desember 2022 selama 34 bulan. Penelitian ini menggunakan metode kuantitatif dengan penelitian deskriptif dan verikatif.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa *Trading Volume* dan Nilai Kapitalisasi berpengaruh secara signifikan terhadap *Return* Saham, Frekuensi Perdagangan dan Harga saham tidak berpengaruh signifikan terhadap *Return* Saham. Sedangkan hasil secara simultan menunjukkan bahwa Frekuensi Perdagangan, *Tading Volume*, Nilai Kapitalisasi dan Harga saham berpengaruh signifikan terhadap *Return* Saham.

Kata Kunci: Frekuensi Perdagangan, *Trading Volume Activity*, Nilai Kapitalisasi, Harga Saham, *Retrun* Saham.