

**Pengaruh *Investor Attention* terhadap *Return*, Likuiditas, dan Volatilitas
Return Saham pada Perusahaan Sektor Manufaktur Indonesia dan
Perusahaan Sektor Properti & *Real Estate* di Malaysia periode 2012-2015**

SKRIPSI

**Diajukan sebagai Salah Satu Syarat untuk Mencapai Gelar Sarjana pada
Program Studi S1 Jurusan Manajemen Fakultas Ekonomi Universitas
Andalas**



1310522042

Dosen Pembimbing : Sari Surya, SE, MM

PROGRAM STUDI MANAJEMEN

FAKULTAS EKONOMI

UNIVERSITAS ANDALAS

JULI 2017

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menguji dan mengetahui mengenai pengaruh *investor attention* yang diproksikan dengan *Google Insight* (GI) terhadap *return*, likuiditas, dan volatilitas *return* saham. Objek penelitian adalah perusahaan sektor manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indoensia (BEI) dan perusahaan sektor *property & real estate* yang terdaftar Di Bursa Malaysia (KLSE) tahun 2012-2015. Perusahaan sampel pada sektor manufaktur dan sektor *property & real estate* sebanyak 17 perusahaan dan 8 perusahaan, yang keduanya dipilih berdasarkan metode *purposive sampling*. Pengujian hipotesis dilakukan dengan menggunakan analisis regresi berganda dengan program SPSS (*Statistic Program for Social Science*). Hasil penelitian menunjukkan bahwa *investor attention* berpengaruh terhadap likuiditas dan volatilitas *return* saham, sedangkan untuk *variable return* tidak berpengaruh signifikan. Hal ini dikarenakan kondisi pasar Indonesia dan Malaysia yang masih tergolong *emerging market*.

Kata Kunci : *investor attention, return, likuiditas, volatilitas return saham, Google Insight*

