

**PENGARUH *FOREIGN OWNERSHIP* TERHADAP
RETURN VOLATILITY DAN *TRADING VOLUME*
INDEKS LQ45 TAHUN 2017-2020**

SKRIPSI

*Diajukan Sebagai Salah Satu Syarat untuk Mencapai Gelar Sarjana Pada
Program Studi SI Manajemen Fakultas Ekonomi Universitas Andalas*



Ardeva Ranti

1710526021

Dosen Pembimbing

Fajri Adrianto, SE, M.Bus, Ph.D

JURUSAN MANAJEMEN

FAKULTAS EKONOMI

UNIVERSITAS ANDALAS

PADANG

2021



No. Alumni Universitas: **Ardeva Ranti** No. Alumni Fakultas:

a) Tempat/Tgl. Lahir: Solok/ 30 Desember 1995 b) Nama Orang Tua: Tusepriandi dan Yuliasri c) Fakultas: Ekonomi d) Jurusan: Manajemen e) No. BP: 1710526021 f) Tanggal Lulus: 25 November 2021 g) Predikat Lulus: Sangat Memuaskan h) IPK: 3..... i) Lama Studi: 4 Tahun 4 Bulan j) Alamat Orang Tua : Perumnas Taman Asri Tahap II Jorong Halaban, Kec. Kubung, Kab. Solok

PENGARUH FOREIGN OWNERSHIP TERHADAP RETURN VOLATILITY DAN TRADING VOLUME INDEKS LQ45 TAHUN 2017-2020

*Skripsi oleh Ardeva Ranti
Pembimbing: Fajri Adrianto, SE, M.Bus, Ph.D*

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui bagaimana pengaruh *foreign ownership* terhadap *return volatility* dan *trading volume* indeks LQ45 tahun 2017-2020. Penelitian ini menggunakan variabel kontrol *size*, *leverage*, *turnover* dan *market-to-book value*. Jenis data yang digunakan adalah data panel dengan sumber data sekunder. Sampel penelitian yang digunakan sebanyak 24 perusahaan dengan total 96 observasi. Analisis data yang dilakukan yaitu Analisis Statistik Deskriptif, Uji Asumsi Klasik, Analisis Regresi dan pemilihan model regresi dengan Uji Chow dan Uji Hausman, serta Uji Hipotesis dengan Uji Parsial (Uji T) dan Uji Simultan (Uji F). Hasil penelitian menemukan bahwa *foreign ownership* memiliki pengaruh negatif signifikan terhadap *return volatility* dan *trading volume*. Hasil empiris menjelaskan bahwa Model regresi yang didapatkan dengan Uji Chow dan Uji Hausman yaitu model *fixed effect*. Hasil pengujian dari dua hipotesis didapatkan bahwa hipotesis pertama diterima dan hipotesis kedua ditolak.

Keyword: Foreign Ownership, Return Volatility, Trading Volume

Skripsi telah dipertahankan di depan sidang penguji dan dinyatakan lulus pada tanggal 25 November 2021.

Abstrak telah disetujui oleh:

Tanda Tangan	1.	2.	3.
Nama Terang	Fajri Adrianto, SE, M.Bus, Ph.D	Dr. Masyhuri Hamidi, SE, M.Si, CFP	Dr. M. Fany Alfarisi, SE, M.Fin

Mengetahui,
Ketua Jurusan Manajemen



Hendra Lukito, SE, MM, Ph.D
NIP. 1706242006041007

Tanda Tangan

Alumni telah mendaftarkan ke Fakultas/ Universitas dan Mendapat Nomor Alumni:

No. Alumni Fakultas	Nama:	Petugas Fakultas/Universitas
No. Alumni Universitas	Nama:	Tanda Tangan:
		Tanda Tangan:

