

## ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh *Firm Size*, *Leverage*, *Sales Growth*, *Trading Volume* Dan *Asset Growth* Terhadap Volatilitas Harga Saham pada perusahaan manufaktur sektor industri barang konsumsi yang terdaftar di BEI tahun 2011-2016.

Populasi yang digunakan dalam penelitian ini adalah perusahaan manufaktur sektor industri barang konsumsi yang terdaftar di BEI tahun 2011-2016. Sampel yang digunakan dalam penelitian ini adalah sebanyak 14 perusahaan dengan menggunakan metode *purposive sampling*. Data yang digunakan diperoleh dari Indonesian Capital Market Directory (ICMD), IDX Annual Report, dan website [www.idx.co.id](http://www.idx.co.id). Teknis analisis yang digunakan adalah analisis regresi linier berganda, uji statistik t, uji f, uji koefisien determinasi, dan uji asumsi klasik yang terdiri dari uji normalitas, uji multikolinearitas, uji autokorelasi, dan uji heterokedastisitas.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa variabel-variabel independen secara simultan (uji F) berpengaruh terhadap Volatilitas Harga Saham dengan tingkat signifikansi 0,000. Sedangkan secara parsial (uji t) menunjukkan bahwa *Leverage* mempunyai pengaruh positif dan tidak signifikan terhadap Volatilitas Harga Saham. *Asset Growth* mempunyai pengaruh negatif dan tidak signifikan terhadap Volatilitas Harga Saham. *Firm Size* mempunyai pengaruh negatif dan signifikan terhadap Volatilitas Harga Saham. Sedangkan *Sales Growth* dan *Volume Perdagangan* mempunyai pengaruh positif dan signifikan terhadap Volatilitas Harga Saham. Nilai adjusted R<sup>2</sup> sebesar 0,215 yang berarti bahwa kemampuan kelima variabel independen dapat menjelaskan Volatilitas Harga Saham sebesar 21,5%, sedangkan sisanya dijelaskan oleh faktor lain.

***Kata Kunci : Volatilitas Harga Saham, Firm Size, Leverage, Sales Growth, Trading Volume, Asset Growth.***