

Abstract: Based on data of IDX in 2016, there are the most high-value sectors as the financial (banking), consumer goods (pharmaceutical), and infrastructure, utilities, and transportation (telecommunication). In every investment, an investor wants a return from dividends and capital gains. There are many factors that can affect the return like the volume of trade, interest and exchange rate. This study aims to analyze the effect of trading volume, interest and exchange rate on dividends and capital gains. This research uses quantitative method with secondary data. The result is a significant trade volume for dividend of pharmacy and banking and significant exchange rate to dividend in telecommunication. In the other hand the volume of trade, interest or exchange rate does not affect capital gains in the pharmaceutical, telecommunications and banking. Dividend and capital gains from the three sub sectors are fluctuating with the greatest dividend and capital gain value by the pharmaceutical.

Keywords: capital gain, dividend, interest rate, money exchange, return, trade volume.

Abstrak: Berdasarkan data di BEI tahun 2016, terdapat tiga sektor tertinggi nilai sahamnya yaitu sektor keuangan (subsektor perbankan), industri barang konsumsi (subsektor farmasi), dan sektor infrastruktur, utilitas, & transportasi (subsektor telekomunikasi). Pada setiap investasi, investor menginginkan adanya return berupa deviden dan capital gain. Terdapat banyak faktor yang dapat mempengaruhi return, salah satunya yaitu volume perdagangan, suku bunga, dan nilai tukar uang (kurs). Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh volume perdagangan, suku bunga, dan kurs terhadap deviden dan capital gain. Penelitian ini menggunakan metode kuantitatif dengan data sekunder. Hasil dari penelitian ini yaitu volume perdagangan berpengaruh signifikan terhadap deviden subsektor farmasi dan perbankan serta kurs berpengaruh signifikan terhadap deviden pada subsektor telekomunikasi. Sedangkan volume perdagangan, suku bunga, ataupun kurs tidak berpengaruh terhadap capital gain pada subsektor farmasi, telekomunikasi dan perbankan. Nilai deviden dan capital gain dari tiga subsektor berfluktuatif dengan nilai deviden dan capital gain paling besar diberikan oleh subsektor farmasi.

Kata kunci: capital gain, deviden, nilai tukar uang, return, suku bunga, volume perdagangan.