

ABSTRACT

This study aims to examine and analyze the effect of the company size, and the corporate financial performance towards stock return. The research data is annually data for the four-years observation period (2013-2016). Sampling method used is purposive sampling. The population consists of 68 companies. The company that selected to sample consists of 32 companies. Analysis method used is data panel regression. The results showed company size and the corporate financial performance together (simultaneously) significantly influence towards stock return. Partially company size have a negative and significant effect on the stock return while Price to Book Value and Debt to Equity Ratio has a positive and significant effect on the stock return and Price Earning Ratio has a positive and no significant influence on the stock return.

Keywords: stock return, company size, Price to Book Value, Debt to Equity Ratio and Price Earning Ratio.



ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan menguji dan menganalisa pengaruh ukuran perusahaan dan kinerja keuangan terhadap return saham. Data penelitian merupakan data tahunan untuk periode observasi empat tahun (2013-2016). Metode sampling yang digunakan adalah purposive sampling. Jumlah populasi terdiri dari 68 perusahaan. Perusahaan yang terpilih sebagai sampel terdiri dari 32 perusahaan. Metode analisis yang digunakan adalah regresi data panel. Hasil penelitian menunjukkan ukuran perusahaan dan kinerja keuangan secara bersama-sama (simultan) berpengaruh secara signifikan terhadap return saham. Secara parsial ukuran perusahaan berpengaruh negatif dan signifikan terhadap return saham sedangkan Price to Book Value dan Debt to Equity Ratio berpengaruh positif dan signifikan terhadap return saham dan Price Earning Ratio berpengaruh positif dan tidak signifikan terhadap return saham.

Kata kunci: return saham, ukuran perusahaan, Price to Book Value, Debt to Equity Ratio dan Price Earning Ratio.



UNIVERSITAS
MERCU BUANA