

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh ROA, DER, QUICK RATIO dan PBV terhadap *Return Saham* pada Perusahaan sektor Perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2015-2016. Pendekatan penelitian yang digunakan dalam penelitian ini adalah metode pendekatan deskriptif dan verifikatif dengan menggunakan data kuantitatif. Teknik sampling yang digunakan dalam penelitian ini, adalah *non probability sampling* dengan menggunakan metode *purposive sampling*, yaitu teknik penentuan sampel dengan pertimbangan tertentu. Banyaknya populasi penelitian adalah enam puluh sembilan perusahaan sedangkan jumlah sampel yang masuk kriteria sampling adalah tiga puluh enam perusahaan Perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia selama 2015-2016 dengan sumber data yang diperoleh melalui situs resmi perusahaan Perbankan dan Bursa Efek Indonesia. Analisis statistik yang digunakan dalam penelitian ini adalah uji asumsi klasik, analisis regresi, korelasi, pengujian hipotesis dengan menggunakan uji t dan uji F serta analisis koefisiensi determinasi.

Berdasarkan hasil penelitian yang dilakukan dapat diketahui bahwa yang paling memberikan pengaruh terbesar terhadap harga saham adalah nilai PBV. Namun secara bersama – sama ROA, DER, Quick Ratio dan PBV berpengaruh terhadap harga saham sebesar 88%.

Kata Kunci: *Return On Asset (ROA), Debt to Equity (DER), Quick Ratio, Price to Book Value (PBV), Return saham*

ABSTRACT

This study aims to determine the effect of ROA, DER, Quick Ratio and PBV on Stock Returns in the Banking Sector listed on the Indonesia Stock Exchange period 2015-2016.

*The research approach used in this research is descriptive and verification method by using quantitative data. Sampling technique used in this research, is non probability sampling by using purposive sampling method, that is sample determination technique with certain consideration. The number of study population is sixty nine companies while the sample number that entered the sampling criteria is thirty six Banking company listed in Indonesia Stock Exchange during 2015-2016 with data source obtained through official website of Banking and Stock Exchange Indonesia. Statistical analysis used in this research is classical assumption test, regression analysis, correlation, hypothesis test by using *t* test and *F* test and coefficient of determination analysis.*

Based on the results of research conducted shown that giving the biggest influence to stock price is the value of PBV. Variable ROA, DER, Quick Ratio and PBV effect on stock return magnitude influence is equal to 88%.

Keywords: *Return On Asset (ROA), Debt to Equity (DER), Quick Ratio, Price to Book Value (PBV), Stock Return*

MERCU BUANA