

ABSTRACT

The study aims to determine how much influence the Loan to Deposit Ratio, Capital Adequacy Ratio, and Return On Equity have on stock returns of conventional government-owned banks (SOEs) listed on the Indonesia Stock Exchange (BEI) for the period 2010-2017. The data used uses secondary data sourced from conventional domestic banking financial reports that are on the Indonesia Stock Exchange from 2010 to 2017. The analytical method used in this study is multiple linear regression. This research is classified as associative research. The population in this study are all conventional domestic banking sub-sector companies on the Indonesia Stock Exchange. The simultaneous test results (f test) of this study indicate that the ratio of LDR, CAR and ROE has an effect on stock returns in conventional domestic banking companies. the results of the partial test (t test) show that the LDR ratio has a significant negative effect on stock returns, CAR has a significant positive effect on stock returns, whereas ROE does not have a significant effect on stock returns.

Keywords : LDR, CAR, ROE, Stock Return.



ABSTRAK

Penelitian bertujuan untuk mengetahui seberapa besar pengaruh *Loan to Deposit Ratio*, *Capital Adequacy Ratio*, dan *Return On Equity* terhadap *return* saham perbankan konvensional milik pemerintah (BUMN) yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2010-2017. Data yang di gunakan menggunakan data sekunder yang bersumber dari laporan keuangan perbankan konvensional dalam negeri yang ada di Bursa Efek Indonesia pada tahun 2010 sampai dengan tahun 2017. Metode analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah regresi linier berganda. Penelitian ini tergolong penelitian asosiatif. Populasi dalam penelitian ini adalah seluruh perusahaan sub sektor perbankan konvensional dalam negeri di Bursa Efek Indonesia. Hasil uji simultan (uji f) penelitian ini menunjukkan bahwa rasio LDR, CAR dan ROE berpengaruh terhadap *return* saham pada perusahaan perbankan konvensional dalam negeri. hasil uji parsial (uji t) menunjukkan bahwa rasio LDR mempunyai pengaruh negatif signifikan terhadap *return* saham, CAR mempunyai pengaruh positif signifikan terhadap *return* saham, sedangkan ROE tidak mempunyai pengaruh signifikan terhadap *return* saham.

Kata Kunci : LDR, CAR, ROE, *Return* Saham.

