

ABSTRACT

This study examines and analyses the factors that influence stock returns in the property and real estate sectors listed on the Indonesia Stock Exchange. Research data is annual data for the 2015 to 2020 observation period obtained from the company's annual report. The sampling method used is purposive sampling. Of the 79 companies as a population, nine companies were taken as samples. Furthermore, based on the Chow and Hausman tests, the data analysis method used in this study was panel data regression with a fixed-effect model. The results showed that the current ratio and total assets turnover significantly affected stock returns. In contrast, the return on assets and debt to asset ratios do not affect stock returns.

Keywords: current ratio, return on assets, debt to asset ratio, total assets turnover, stock return



UNIVERSITAS
MERCU BUANA

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menguji dan menganalisis tentang faktor-faktor yang mempengaruhi return saham sektor properti dan real estate yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Data penelitian adalah data tahunan untuk periode observasi tahun 2015 sampai 2020 yang diperoleh dari laporan tahunan perusahaan. Metode pengambilan sampel yang digunakan adalah purposive sampling. Dari 79 perusahaan sebagai populasi, diambil 9 perusahaan yang memenuhi sebagai sampel. Selanjutnya berdasarkan hasil uji chow dan hausman, metode analisis data yang digunakan dalam penelitian ini adalah regresi data panel dengan fixed effect model. Hasil penelitian menunjukkan bahwa current ratio dan total assets turnover berpengaruh positif terhadap return saham. Sedangkan return on asset dan debt to asset ratio tidak berpengaruh terhadap return saham.

Kata Kunci : *current ratio, return on asset, debt to asset ratio, total assets turnover, return saham*



UNIVERSITAS
MERCU BUANA