

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh profitabilitas, likuiditas, dan *leverage* terhadap *return* saham. Populasi dalam penelitian ini adalah 66 perusahaan sektor Energi. Sampel yang digunakan adalah sebanyak 11 perusahaan sektor Energi, dihitung berdasarkan pada persyaratan yang ditetapkan peneliti. Metode penarikan sampel menggunakan *purposive sampling*. Metode pengumpulan data menggunakan studi kepustakaan, dengan instrumen bahan atau data yang berkaitan menggunakan obyek pembahasan dan unduhan data laporan keuangan sektor Energi yang di Bursa Efek Indonesia periode 2017 – 2020. Metode analisis data menggunakan Regresi Data Panel dan didapatkan bahwa model yang lebih tepat digunakan adalah *common effect*. Dari hasil penelitian secara parsial menunjukkan bahwa variabel *return on equity* (ROE) berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham. Tetapi variabel CR secara parsial tidak berpengaruh terhadap *return* saham dan variabel DER secara parsial berpengaruh negatif dan tidak signifikan terhadap *return* saham.

Kata Kunci : ROE, CR, DER, Sektor Energi, *Return* Saham.



ABSTRACT

This study aims to analyze the effect of profitability, liquidity, and leverage on stock returns. The population in this study are 66 companies in the energy sector. The sample used was 11 companies in the Energy sector, calculated based on the requirements set by the researcher. Sampling method using purposive sampling. The data collection method uses a literature study, with instrument materials or related data using the object of discussion and download of Energy sector financial report data on the Indonesia Stock Exchange for the period 2017 – 2020. The data analysis method uses Panel Data Regression and it is found that a more appropriate model is used is a common effect. The partial results of the research show that the variable return on equity (ROE) has a positive and significant effect on stock returns. But the CR variable partially has no effect on stock returns and the DER variable partially has a negative and insignificant effect on stock returns.

Keywords: ROE, CR, DER, Energy Sector, Stock Return.



UNIVERSITAS
MERCU BUANA