

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui Pengaruh Rasio Profitabilitas, *Leverage*, Likuiditas dan Ukuran Perusahaan Terhadap *Return* Saham Sub Sektor Barang Perindustrian Yang Tercatat Di Bursa Efek Indonesia (BEI) Periode 2016-2020. Sampel yang digunakan dalam penelitian ini adalah 16 perusahaan dari sub sektor barang perindustrian yang terdaftar pada BEI pada periode 2016-2020. Metode penarikan sampel menggunakan *purposive sampling*. Metode pengumpulan data menggunakan metode penelitian kepustakaan (*Library Research*). Metode analisis data menggunakan metode analisis regresi data panel dengan menggunakan bantuan aplikasi Eviews12, yang digunakan untuk mengetahui seberapa jauh tingkat signifikansi dan apakah ada/tidaknya pengaruh antara variabel independen yaitu Profitabilitas (ROE), *Leverage* (DER), Likuiditas (CR) dan Ukuran Perusahaan (FS) terhadap variabel dependen yaitu *return* saham. Populasi dalam penelitian ini sebanyak 29 perusahaan dan sampel yang digunakan sebanyak 16 perusahaan. Berdasarkan hasil uji yang telah dilakukan, bahwa Profitabilitas (ROE) berpengaruh positif terhadap *return* saham, *Leverage* (DER) berpengaruh positif terhadap *return* saham, Likuiditas (CR) tidak berpengaruh positif terhadap *return* saham dan Ukuran Perusahaan (FS) berpengaruh negatif terhadap *return* saham.

Kata Kunci: Profitabilitas, *Leverage*, Likuiditas, Ukuran Perusahaan, *Return* Saham.



UNIVERSITAS
MERCU BUANA

ABSTRACT

This study aims to determine the Effect of Profitability, Leverage, Liquidity and Firm Size Ratios on The Return of Industrial Goods Sub-Sector Stocks Listed on the Indonesia Stock Exchange (IDX) for the period 2016-2020. The sample used in this study was 16 companies from the industrial goods sub-sector listed on the IDX in the period 2016-2020. The sample withdrawal method uses purposive sampling. Data collection methods use library research methods. The data analysis method uses the panel data regression analysis method using the help of the Eviews12 application, which is used to determine how far the level of significance is and whether there is / not an influence between the independent variables namely Profitability (ROE), Leverage (DER), Liquidity (CR) and Company Size (FS) on the dependent variable, namely stock return. The population in this study was 29 companies and the sample used was 16 companies. Based on the results of tests that have been conducted, that Profitability (ROE) has a positive effect on stock returns, Leverage (DER) has a positive effect on stock returns, Liquidity (CR) does not have a positive effect on stock returns and Company Size (FS) has a negative effect on stock returns.

Keyword: Profitability, Leverage, Likuidity, Firm Size, Stock Return.



UNIVERSITAS
MERCU BUANA