

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis dan menguji tentang faktor –faktor yang mempengaruhi return saham sektor Consumer goods yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Data penelitian merupakan data tahunan untuk periode observasi tahun 2016 sampai 2021 yang diperoleh dari laporan tahunan perusahaan. Metode pengambilan sample yang di gunakan adalah purposive sampling, dari 57 perusahaan sebagai populasi diambil 15 perusahaan yang memenuhi sebagai sampel. Kemudian berdasarkan uji chow dan uji hausman, metode analisis data yang digunakan dalam penelitian ini yaitu regresi data panel dengan fixed effect model. Hasil penelitian telah menunjukkan bahwa return on asset berpengaruh positif terhadap return saham, debt to aset ratio berpengaruh negative terhadap return saham, sedangkan curent ratio, total asset turnover, dan firm size tidak berpengaruh terhadap return saham.

Kata Kunci : Return on asset, Curent ratio, Debt to asset ratio, Total aset turnover, Firm size



ABSTRACT

This research aims to analyze and examine the factors that influence the stock return of the consumer goods sector listed on the Indonesia Stock Exchange. The research data is annual data for the observation period from 2016 to 2021 obtained from the company's annual report. The sampling method used was purposive sampling. from 57 companies as a population, 15 companies were taken as samples. Then based on the Chow test and Hausman test, the data analysis method used in this study is panel data regression with Fixed Effect Mode. The results of the study have shown that Return on Assets has a positive effect on stock returns, debt to Assets ratio has a negative effect on stock returns, while current ratio, total asset turnover, and firm size have no effect on stock returns.

Keywords: Return on asset, Curent ratio, Debt to aset ratio, Total asset turnover, Firm size

