

## ABSTRAK

### **Pengaruh Rasio Profitabilitas, Rasio Likuiditas dan Rasio Pasar pada *Return* Saham Perusahaan Manufaktur di Sektor Aneka Industri yang Terdaftar di BEI Selama Periode 2014-2017**

Penelitian ini dilakukan untuk menguji pengaruh rasio keuangan secara parsial dan simultan terhadap *return* saham perusahaan manufaktur di sektor aneka industri yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia selama periode 2014-2017. Teknik sampling yang digunakan dalam penelitian adalah *purposive sampling* dan diperoleh sampel sebanyak 23 perusahaan selama periode 4 tahun. Data yang diteliti diperoleh dari laporan keuangan yang di publikasikan di *idx.co.id*. Metode analisis data yang digunakan adalah analisis regresi linier berganda.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa rasio profitabilitas dengan di proksikan *Return on Asset* (ROA) dan rasio pasar dengan di proksikan *Earning per Share* (EPS) secara parsial tidak berpengaruh terhadap *return* saham. Sedangkan rasio likuiditas dengan di proksikan *Current Ratio* (CR) secara parsial berpengaruh secara positif dan signifikan terhadap *return* saham. Hasil Uji F menunjukkan tingkat signifikansi 0,072 yang lebih besar dari taraf signifikansi 0.05. sehingga rasio profitabilitas di proksikan *Return on Asset* (ROA), rasio pasar di proksikan *Earning per Share* (EPS) dan rasio likuiditas di proksikan *Current Ratio* (CR) secara simultan tidak berpengaruh terhadap *return* saham. Hasil koefisien determinan diperoleh nilai *Adjusted R Square* sebesar 0,109, yang berarti bahwa variabel *Return* Saham sebagai variabel dependen mampu dijelaskan oleh variabel independen sebesar 10,9% dan sisanya 89,1% dijelaskan oleh variabel lain yang tidak tercakup dalam penelitian ini.

Kata kunci : Rasio Profitabilitas, Rasio Likuiditas, Rasio Pasar, *Return* Saham

## ABSTRACT

### ***Influence of Profitability Ratios, Liquidity Ratios and Market Ratios on Stock Returns of Manufacturing Companies in miscellaneous industry Listed on the Indonesia Stock Exchange for The Period 2014-2017***

*This research performed to examine the effect of financial ratios partially and simultaneously on stock returns of manufacturing companies in miscellaneous industry listed on the Indonesia Stock Exchange for periode 2014-2017. The sampling technique used in the research is purposive sampling and a sample of 23 companies in the 4-year period. The research data is obtained from financial statements published on idx.co.id. The data analysis method used is multiple linear regression analysis.*

*The results of this research indicate that the profitability ratio with Return on Assets (ROA) and the market ratio with Earning per Share (EPS) partially have no effect on stock returns. While liquidity ratios with Current Ratio (CR) partially have a positive and significant effect on stock returns. The F test results show a significant level of 0.072 greater than the significance level of 0.05. So that the profitability ratio is proxied Return on Assets (ROA), the market ratio is proxied Earning per Share (EPS) and the liquidity ratio proxied Current Ratio (CR) simultaneously has no effect on stock returns. The determinant coefficient results obtained Adjusted R Square value of 0.109, which means that the Stock Return variable as the dependent variable can be explained by the independent variable at 10.9% and the remaining 89.1% is explained by other variables not covered in this study.*

*Keyword: Profitability Ratios, Liquidity Ratios, Market Ratios, Stock Returns*