

ABSTRAK

Judul penelitian Pengaruh Profitabilitas, Nilai Perusahaan, Ukuran Perusahaan Terhadap Return Saham. Investasi pada dasarnya yaitu menempatkan sebagian dana atau kekayaan pada masa sekarang dengan maksud dan tujuan untuk mendapatkan manfaat di masa yang akan datang. Sedangkan manfaat investasi yaitu peningkatan aset atau nilai kekayaan dalam mengantisipasi ketidakpastian di masa depan serta proteksi terhadap gejolak inflasi, bahwa setiap investasi baik jangka pendek maupun jangka panjang mempunyai tujuan utama yaitu memperoleh keuntungan yang sering disebut *Return*.

Jenis penelitian kuantitatif, populasi perusahaan manufaktur LQ 45 yang terdaftar di BEI pada periode 2014-2017, dengan sampel 44 perusahaan secara *purposive sampling*, metode analisis data menggunakan statistik deskriptif, dan uji asumsi klasik (uji normalitas, uji multikolinearitas, uji heteroskedastisitas, uji autokorelasi), regresi linier berganda, uji t, uji F, uji R^2 .

Hasil uji asumsi klasik, data terdistribusi secara normal, tidak terjadi multikolinearitas, tidak terjadi heteroskedastisitas, tidak terjadi autokorelasi. Hasil uji t menunjukkan ROA berpengaruh positif signifikan terhadap *return saham* dengan nilai sig $0,000 < 0,05$. Nilai Perusahaan berpengaruh positif terhadap *return saham* dengan nilai sig $0,002 < 0,05$. Ukuran Perusahaan berpengaruh positif signifikan terhadap *return saham* dengan nilai sig $0,000 < 0,05$. Hasil penelitian menunjukkan bahwa variabel independen bersama-sama berpengaruh terhadap *return saham* dengan nilai uji F sebesar sig. $0,000 < 0,05$. Uji R^2 menunjukkan 53,8% sedangkan sisanya sebesar 46,2% variabel independen dapat menerangkan variabel dependen.

Kata kunci : *Return* saham, ROA, Nilai Perusahaan, Ukuran Perusahaan

ABSTRACT

The research title is Effect of Profitability, Firm Value, Firm Size on Stock Return. Investment basically is to place some funds or wealth in the present with the intent and purpose to get benefits in the future. While the investment benefits of increasing assets or the value of wealth in anticipating future uncertainty and protection against inflation fluctuations, that every investment both short and long term has the main goal of obtaining profits which are often called Returns.

Type of quantitative research, population of LQ 45 manufacturing companies listed on the Indonesia Stock Exchange in the period 2014-2017, with a sample of 44 companies by purposive sampling, data analysis methods using descriptive statistics, and classic assumption tests (normality test, multicollinearity test, heteroscedasticity test, autocorrelation test), multiple linear regression, t test, F test, R² test.

The classical assumption test results, data are normally distributed, multicollinearity does not occur, heteroscedasticity does not occur, autocorrelation does not occur. T test results showed ROA significant positive effect on stock returns with a sig value of $0,000 < 0.05$. Company value has a positive effect on stock returns with sig $0.002 < 0.05$. Company size has a significant positive effect on stock returns with a sig value of $0,000 < 0.05$. The results showed that the independent variables together affect the stock return with the F test value of sig. $0,000 < 0.05$. R² test shows 53.8% while the remaining 46.2% independent variables can explain the dependent variable.

Keywords: Stock return, ROA, Company Value, Company Size.