

ABSTRAKSI

Dian Listiani, Nomor Induk Mahasiswa 152140084, Jurusan Ilmu Administrasi Bisnis Fakultas Ilmu Sosial dan Ilmu Politik Universitas Pembangunan Nasional “Veteran” Yogyakarta. Judul Penelitian Pengaruh Rasio Likuiditas, Solvabilitas dan Profitabilitas Terhadap *Return* Saham Dengan *Beta* Sebagai Variabel Intervening Studi Pada Perusahaan Sektor *Consumer Goods* yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2013-2017. Dosen Pembimbing I : Sadeli dan Dosen Pembimbing II : Indro Herry Mulyanto.

Tujuan utama dari penelitian ini adalah untuk mengetahui pengaruh dari beberapa variabel bebas rasio likuiditas yaitu *Current Ratio* (CR), rasio solvabilitas yaitu *Debt to Equity Ratio* (DER) dan rasio profitabilitas yaitu *Return On Asset* (ROA) terhadap variabel terikat *return* saham dengan variabel intervening *Beta* pada perusahaan *consumer goods* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia tahun 2013-2017.

Jenis penelitian ini adalah penelitian eksplanasi asosiatif. Teknik pengambilan sampel menggunakan teknik *purposive sampling*. Dari 49 perusahaan *consumer goods* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia, hanya diambil sebanyak 25 perusahaan, karena memiliki laporan keuangan secara lengkap tahun 2013-2017. Teknik analisis menggunakan analisis jalur yang sebelumnya diuji dengan uji asumsi klasik kemudian uji t untuk mengetahui hasil hipotesis secara parsial dan uji sobel untuk mengetahui pengaruh variabel intervening.

Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwa *Current Ratio* (CR) berpengaruh signifikan terhadap *Return* Saham dengan nilai signifikan sebesar 0,000. *Debt Equity Ratio* (DER) berpengaruh signifikan terhadap *Return* Saham dengan nilai signifikan sebesar 0,037. *Return On Asset* (ROA) berpengaruh signifikan terhadap *Return* Saham dengan nilai signifikan sebesar 0,047. *Current Ratio* (CR) berpengaruh signifikan terhadap *Beta* dengan nilai signifikan sebesar 0,003. *Debt Equity Ratio* (DER) berpengaruh signifikan terhadap *Beta* pada perusahaan *consumer goods* dengan nilai signifikan sebesar 0,000. *Return On Asset*

(ROA) berpengaruh terhadap *Beta* dengan nilai signifikan sebesar 0,000. *Beta* berpengaruh signifikan terhadap *Return Saham* dengan nilai signifikan sebesar 0,005. *Current Ratio* (CR) berpengaruh signifikan terhadap *Return Saham* melalui *Beta* dengan nilai signifikan sebesar 0,036. *Debt Equity Ratio* (DER) berpengaruh signifikan terhadap *Return Saham* melalui *Beta* dengan nilai signifikan sebesar 0,024. *Return On Asset* (ROA) berpengaruh terhadap *Return Saham* melalui *Beta* dengan nilai signifikan sebesar 0,023.

Kata kunci : rasio likuiditas, rasio solvabilitas, rasio profitabilitas, *return* saham dan *Beta*.