

ABSTRAK

PENGARUH PROFITABILITAS, LEVERAGE, DAN MARKET RATIO TERHADAP RETURN SAHAM

(Perusahaan Manufaktur *Sektor Food And Beverages* Yang Terdaftar Di Bursa
Efek Indonesia Pada Periode 2018-2020)

ZUKHRUF FAUZAN MOCHSIN

141180242

Mahasiswa Program Studi Manajemen

Fakultas Ekonomi dan Bisnis UPN “Veteran” Yogyakarta

(zukhrufocre@gmail.com)

(+62)89687705316

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menguji dan menganalisis pengaruh Profitabilitas, *Leverage*, dan *Market Ratio* terhadap *Return Saham* baik secara bersama-sama maupun secara individu terhadap *Return* saham. Populasi dalam penelitian ini adalah perusahaan *Food and Beverages* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2018-2020. Pemilihan sampel ditentukan menggunakan metode *purposive sampling*. Berdasarkan metode ini, diperoleh 20 unit analisis. Alat analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah Analisis Regresi Linier Berganda dengan uji asumsi klasik, Uji *F-Statistik*, Uji Koefisien Determinasi R^2 dan Uji *t-statistik* dengan *level of significance* 5 persen. Hasil penelitian ini menghasilkan persamaan regresi yaitu: **RS = -3,659 + 1,923 ROE + 0,089 DAR + 0,015 DER - 0,008 EPS - 0,029 PER + e**. Berdasarkan hasil pengujian hipotesis dengan menggunakan analisis regresi berganda dengan variabel independen secara bersama-sama berpengaruh signifikan terhadap *Return* saham. Sedangkan secara individu terdapat dua variabel yang berpengaruh signifikan terhadap *Return* saham yaitu ROE, dan DAR. Penelitian ini menghasilkan *R square* sebesar 52,6% sedangkan sisanya 47,4% dijelaskan oleh variabel lain diluar persamaan model.

Kata Kunci: *Leverage*, *Market Ratio*, Profitabilitas, *Return Saham*