

ABSTRAKSI

Fajar Afiat Wijaya, Nomor Induk Mahasiswa 152180094, Program Studi Ilmu Administrasi Bisnis Fakultas Ilmu Sosial dan Ilmu Politik Universitas Pembangunan Nasional “Veteran” Yogyakarta, Judul Penelitian “Pengaruh *Return on Assets*, *Debt to Equity Ratio*, dan *Total Assets Turnover* terhadap *Return Saham* (Studi pada Perusahaan - Perusahaan Sektor Pertanian yang Tercatat di Bursa Efek Indonesia Tahun 2018 – 2020)”, 2022. Dosen Pembimbing I Indro Herry Mulyanto dan Dosen Pembimbing II Suratna.

Penelitian ini bertujuan untuk menjelaskan pengaruh *Return on Assets*, *Debt to Equity Ratio*, dan *Total Assets Turnover* terhadap *Return Saham* (Studi pada Perusahaan Sektor Pertanian yang Tercatat di Bursa Efek Indonesia Tahun 2018 – 2020). Teknik sampling yang digunakan adalah *nonprobability sampling* dengan *purposive sampling*. Analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah regresi linear berganda. Selain itu juga dilakukan uji hipotesis parsial dan simultan guna mengukur pengaruh variabel bebas terhadap variabel terikat.

Hasil uji pada penelitian ini menunjukkan bahwa persamaan regresi $Y = -0,111 + 0,315X_1 + 0,006X_2 + 0,072X_3$. Hasil hipotesis secara parsial menunjukkan bahwa *Return on Assets* berpengaruh tidak signifikan terhadap *Return Saham*. *Debt to Equity Ratio* berpengaruh tidak signifikan terhadap *Return Saham*. *Total Assets Turnover* berpengaruh tidak signifikan terhadap *Return Saham*. Hal ini diperkuat dengan hasil koefisien determinasi dimana menunjukkan R Square 6,4% yang mana hasil tersebut sangat jauh dari angka satu ikatan variabel independen dengan variabel dependen lemah. Koefisien determinasi sudah melakukan uji sumbangan efektif dimana nilai ROA, DER, dan TATO apabila di total mendapati hasil 6,4% dimana hasil tersebut sesuai dengan R square pada koefisien determinasi dan sumbangan relatif mendapatkan angka satu dimana semua data sudah terukur.

Saran dari penelitian ini adalah diharapkan bahwa perusahaan dapat memperhatikan kebijakan hutangnya dan memperbaiki dalam operasional perusahaannya. Kondisi kinerja perusahaan juga mengharuskan perusahaan untuk mampu meningkatkan efektivitasnya dalam mengelola asetnya untuk kegiatan operasional perusahaannya terutama dalam penggunaan ekuitas dan aktivitya dimasa pandemi ini.

Kata Kunci : *Return on Assets*, *Debt to Equity Ratio*, *Total Assets Turnover*, dan *Return Saham*