

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menguji pengaruh profitabilitas, *leverage*, likuiditas, dan ukuran perusahaan terhadap *return* saham pada perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2015-2018.

Pengambilan sampel dalam penelitian ini menggunakan metode *purposive sampling*, sehingga perusahaan yang masuk dalam kriteria sampel sebanyak 424 perusahaan. Metode analisis data yang digunakan dalam penelitian ini adalah analisis regresi linear berganda.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa profitabilitas yang berpengaruh positif signifikan terhadap *return* saham. variabel *Leverage*, likuiditas dan ukuran perusahaan berpengaruh positif tidak signifikan terhadap *return* saham.

Kata Kunci : *Return* saham, Profitabilitas, *Leverage*, Likuiditas, Ukuran Perusahaan.

ABSTRACT

This study aims to examine the effect of profitability, Leverage, liquidity, and firm size on the stock return at listed manufacture companies listed on the IDX period 2015-2018.

Sampling in this study used a purposive sampling method, so the number of companies included in the criteria were 424 companies. The data analysis method used in this study is multiple linear regression analysis.

The results of this study indicate that the profitability variable has a positive and significant effect on the stock return. leverage variable positive has no significant effect on the stock return. Liquidity variables have a positive and insignificant effect on the stock return. company size variables has no significant positive effect on the stock return.

Keywords: Stock return. Profitability. Leverage. Liquidity. Company Size