

ABSTRAK

Penelitian ini memiliki tujuan yaitu untuk mengetahui dan menganalisis variabel yang dapat mempengaruhi *return* saham. Pada umumnya perusahaan *property* dan *real estate* banyak diminati oleh investor, karena investasi di bidang tersebut sangat menjanjikan, dikarenakan harga tanah dan bangunan yang semakin naik seiring dengan pertumbuhan ekonomi. *Return* yang tinggi merupakan tujuan utama calon investor menanamkan modalnya pada perusahaan. Namun, semakin tinggi tingkat pengembalian (*return*) yang mungkin akan didapat oleh investor, tidak menutup kemungkinan semakin tinggi pula resiko yang akan dihadapi. Untuk menghindari resiko yang mungkin akan terjadi, investor dapat menggunakan analisis rasio.

Variabel yang diteliti dalam penelitian adalah CR, ROA, DER dan ukuran perusahaan sebagai variabel independen atau variabel bebas serta variabel dependen yaitu *return* saham. Sampel penelitian berjumlah 135 yang kemudian menjadi 105 sampel setelah dilakukan outlier data karena residual belum berdistribusi normal. Sampel yang diolah didapat dari *purposive sampling*. Penelitian ini menunjukkan hasil yaitu variabel ukuran perusahaan memiliki pengaruh positif dan variabel CR, ROA dan DER tidak memiliki pengaruh terhadap *return* saham.

Kata kunci: *Return Saham, Current Ratio, Return on Asset, Debt to Equity Ratio, dan Ukuran Perusahaan.*

ABSTRACT

This study has the aim of knowing and analyzing variables that can affect stock returns. In general, property and real estate companies are in great demand by investors, because investment in this field is very promising, because land and building prices are increasingly rising along with economic growth. High return is the main goal of potential investors to invest their capital in the company. However, the higher the rate of return that an investor might get, it is possible that the higher the risk faced. To avoid risks that might occur, investors can use ratio analysis.

The variables examined in this study are CR, ROA, DER and company size as independent variables or independent variables and dependent variables, namely stock returns. The research sample numbered 135, which then became 105 samples after being carried out outlier data because the residuals were not normally distributed. The processed sample was obtained from purposive sampling. This study shows the results of which the variable firm size has a positive influence and the CR, ROA, and DER variables have no influence on stock returns.

Keywords: Stock Return, Current Ratio, Return on Assets, Debt to Equity Ratio, and Company Size.