

INTISARI

Penelitian ini bertujuan untuk menguji dan menganalisis pengaruh dari Kecukupan Modal, profitabilitas, Likuiditas, dan ukuran perusahaan terhadap return saham. Variabel dependen dalam penelitian ini yaitu return saham. Variabel independen dalam penelitian ini terdiri dari Kecukupan Modal yang diukur dengan Capital Adequacy Ratio (CAR), profitabilitas yang diukur dengan (ROA), Likuiditas yang diukur dengan Loan to Deposit Ratio (LDR), dan ukuran perusahaan yang diukur dengan Total Asset. Objek penelitian ini yaitu perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2013-2018. Data yang digunakan dalam penelitian ini merupakan data sekunder yaitu laporan keuangan tahunan. Sampel penelitian dipilih dengan menggunakan metode purposive sampling dan diperoleh sebanyak 145 sampel. Metode analisis yang digunakan dalam penelitian ini menggunakan regresi linear berganda dengan alat bantu aplikasi E-Views 7.1. Hasil penelitian menunjukkan bahwa Profitabilitas berpengaruh positif signifikan terhadap return saham, dan Ukuran Perusahaan berpengaruh positif signifikan terhadap return saham sedangkan kecukupan modal tidak berpengaruh signifikan terhadap return saham, Likuiditas tidak berpengaruh signifikan terhadap return saham,

Kata kunci : Kecukupan Modal, Likuiditas, Profitabilitas, Ukuran Perusahaan dan Return Saham

ABSTRACT

The purpose of this research is to examine and analyze the Capital Adequacy, profitability, liquidity, and company size on stock returns. The dependent variable in this study is stock returns. The independent variables in this study consisted of Capital Adequacy Ratio with Capital Adequacy Ratio (CAR), profitability required with (ROA), Liquidity obtained by Loan to Deposit Ratio (LDR), and Firm size which increased with Total Assets. The object of this study is a banking company listed on the Indonesia Stock Exchange (IDX) for the period 2013-2018. The data used in this study are secondary data, namely annual financial statements. The research sample was selected using the purposive sampling method and as many as 145 samples were obtained. The analytical method used in this study uses multiple linear regression with the application tool E-Views 7.1. The results showed that profitability had a significant positive effect on stock returns, and Firm size had a significant positive effect on stock returns while capital adequacy did not significantly influence stock returns, liquidity did not significantly influence stock returns,

Keywords: *Capital Adequacy, Liquidity, Profitability, Firm Size and Stock Return*