

## ABSTRAK

**Jihan Hasna Alhakim (1178020118): “Pengaruh Rasio Pasar dan Rasio Profitabilitas Terhadap *Return Saham* Pada Perusahaan Jasa Sub Sektor Transportasi Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia (BEI) Tahun 2012-2019”.**

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh secara parsial dan simultan dari *Return On Equity*, *Return On Asset*, dan *Price to Book Value* terhadap *Return Saham* pada perusahaan jasa sub sektor transportasi yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) tahun 2012-2019. Metode yang digunakan dalam penelitian ini adalah metode deskriptik verifikatif dengan pendekatan kuantitatif. Teknik pengambilan sampel menggunakan teknik *purposive sampling* dengan jumlah sampel 9 perusahaan dari 46 populasi perusahaan. Teknik pengumpulan data pada penelitian ini melalui studi kepustakaan dan laporan keuangan tahunan yang ada di [www.idx.co.id](http://www.idx.co.id), [www.idnfinancials.com](http://www.idnfinancials.com), serta web resmi perusahaan itu sendiri serta data yang digunakan merupakan data sekunder. Pengujian hipotesis yaitu Uji t dan Uji F menggunakan program *Eviews 9* untuk mengetahui ada atau tidaknya pengaruh *return on equity*, *return on asset*, dan *price to book value* terhadap *return saham*.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa secara parsial hanya rasio *Price to Book Value* ( $X_3$ ) yang berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return saham*. Hal tersebut ditunjukkan dengan nilai  $t_{hitung} = 2,473247$  dan nilai  $t_{tabel} = 1,66940$ , maka  $t_{hitung} > t_{tabel}$ . Nilai probabilitas  $X_3$  sebesar 0,0161 yang lebih kecil dari tingkat signifikansi (0,05) dan nilai koefisien  $X_3$  sebesar 0,196709. Secara parsial variabel *Return On Equity* ( $X_1$ ) tidak berpengaruh terhadap *return saham* karena memiliki nilai  $t_{hitung} = -0,029521$  yang berarti  $t_{hitung} \leq t_{tabel}$ . Nilai probabilitas  $X_1$  sebesar 0,9765 yang lebih besar dari tingkat signifikansi (0,05) dan nilai koefisien  $X_1$  sebesar -0,015388. Secara parsial *return on asset* ( $X_2$ ) tidak berpengaruh terhadap *return saham* karena memiliki nilai  $t_{hitung} = 1,385136$  yang berarti  $t_{hitung} \leq t_{tabel}$ . Nilai probabilitas  $X_2$  sebesar 0,1709 yang lebih besar dari tingkat signifikansi dan nilai koefisien  $X_2$  sebesar 1,241085.

Secara simultan *Return On Equity* ( $X_1$ ), *Return On Asset* ( $X_2$ ), dan *Price to Book Value* ( $X_3$ ) berpengaruh signifikan terhadap *Return Saham* pada perusahaan jasa sub sektor transportasi yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) tahun 2012-2019. Hal tersebut ditunjukkan oleh nilai  $F_{hitung} = 4,375711$  dan nilai  $F_{tabel} = 2,75$  yang berarti  $F_{hitung} > F_{tabel}$ . Dan nilai probabilitas (F-statistic) sebesar 0,007327 yang lebih kecil dari 0,05 atau  $0,007327 < 0,05$ . Serta nilai koefisien determinasi sebesar 13,30%.

**Kata Kunci:** *Return On Equity*, *Return On Asset*, *Price to Book Value*, *Return Saham*.