

ABSTRAK

Delia Nur Azidzah (1188020042) : “Pengaruh *Current Ratio*, *Debt to Equity Ratio*, *Return on Equity*, dan *Total Asset Turnover* Terhadap *Return Saham* pada Perusahaan Manufaktur LQ45 Periode 2011 – 2020”

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui bagaimana pengaruh secara parsial maupun secara simultan dari variabel *Current Ratio*, *Debt to Equity Ratio*, *Return on Equity*, dan *Total Asset Turnover* terhadap *Return* saham pada perusahaan manufaktur yang terdaftar di LQ45 periode 2011 – 2020.

Metode yang digunakan dalam penelitian ini yaitu metode deskriptif verifikatif dengan pendekatan kuantitatif. Jenis data yang digunakan adalah data kuantitatif dengan sumber data sekunder. Sampel yang digunakan sebanyak 9 perusahaan dari 20 populasi perusahaan yang dipilih berdasarkan *purposive sampling*. Teknik analisis data yang digunakan pada penelitian ini ialah analisis regresi data panel. Sedangkan uji hipotesis terdiri atas uji t (uji pengaruh parsial), uji F (uji pengaruh simultan) dan uji koefisien determinasi.

Hasil penelitian secara parsial menunjukkan bahwa *Current Ratio* berpengaruh negatif terhadap *Return* saham, dilihat dari nilai t_{hitung} lebih besar dari t_{tabel} dengan arah pengaruh negatif ($9.122435 > 1.66298$) serta nilai *p-value* lebih kecil dari taraf signifikansi ($0.0000 < 0.05$). Secara parsial *Debt to Equity Ratio* berpengaruh negatif terhadap *Return* saham, dilihat dari nilai t_{hitung} lebih besar dari t_{tabel} dengan arah pengaruh negatif ($13.00655 > 1.66298$) serta nilai *p-value* lebih kecil dari taraf signifikansi ($0.0000 < 0.05$). Secara parsial *Return on Equity* berpengaruh positif terhadap *Return* saham, dilihat dari nilai t_{hitung} lebih besar dari t_{tabel} ($16.52117 > 1.66298$) serta nilai *p-value* lebih kecil dari taraf signifikansi ($0.0000 < 0.05$). Secara parsial *Total Asset Turnover* berpengaruh positif terhadap *Return* saham, dilihat dari nilai t_{hitung} lebih besar dari t_{tabel} ($25.37313 > 1.66298$) serta nilai *p-value* lebih kecil dari taraf signifikansi ($0.0000 < 0.05$). Secara simultan *Current Ratio*, *Debt to Equity Ratio*, *Return on Equity*, dan *Total Asset Turnover* berpengaruh terhadap *Return* Saham, dilihat dari F_{hitung} lebih besar dari nilai F_{tabel} ($328.1752 > 2.48$) dengan nilai *prob(F-statistic)* lebih kecil dari nilai taraf signifikansi ($0.00000 < 0.05$). Selain itu, nilai koefisien determinasi (R^2) sebesar 0.980822 atau 98%. Hal ini menunjukkan bahwa *Current Ratio*, *Debt to Equity Ratio*, *Return on Equity*, dan *Total Asset Turnover* dapat mempengaruhi *Return* Saham sebesar 98% pada perusahaan Manufaktur LQ45 Periode 2011 – 2020.

Kata Kunci : *Current Ratio*, *Debt to Equity Ratio*, *Return on Equity*, *Total Asset Turnover*, *Return Saham*