

ABSTRAK

Intan Zahra (1188020096) : PENGARUH *CURRENT RATIO* (CR), *DEBT TO EQUITY RATIO* (DER) DAN *RETURN ON EQUITY* (ROE) TERHADAP *RETURN SAHAM* SEKTOR *CONSUMER GOODS* YANG TERDAFTAR DI BEI PADA PERIODE TAHUN 2016-2020

Investor melakukan investasi untuk mendapatkan keuntungan di masa yang akan datang atau disebut dengan *Return Saham*. Kenaikan dan Penurunan *return* saham dapat disebabkan oleh rasio keuangan yang terdiri dari *current ratio*, *debt to equity ratio*, dan *return on equity*.

Penelitian ini bertujuan untuk menguji pengaruh dari *Current Ratio*, *Debt to Equity Ratio* dan *Return on Equity* terhadap *Return Saham* secara parsial dan simultan pada perusahaan sektor *Consumer Goods* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia Pada Periode 2016-2020.

Metode yang digunakan pada penelitian ini yaitu metode deskriptif verifikatif dengan pendekatan kuantitatif. Sumber data penelitian ini merupakan data sekunder. Sampel dalam penelitian ini menggunakan teknik *purposive sampling*, dan terdapat 4 perusahaan yang menjadi sampel dalam penelitian ini. Teknik pengumpulan data menggunakan teknik studi kepustakaan, riset internet dan penelusuran dokumen. Teknik analisis data dalam penelitian yaitu regresi data panel, terdiri dari analisis deskriptif, analisis regresi data panel, dan uji hipotesis terdiri dari uji t (parsial), uji F (simultan) dan uji koefisien determinasi. Pengolahan data dibantu menggunakan software Eviews 12.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa secara parsial *Current Ratio* tidak berpengaruh signifikan terhadap *Return Saham* dengan nilai t_{hitung} 1.051835 dan probabilitas 0.2967, *Debt to Equity Ratio* tidak berpengaruh signifikan terhadap *Return Saham* dengan nilai t_{hitung} 0.024450 dan probabilitas 0.9806 dan *Return on Equity* berpengaruh signifikan terhadap *Return Saham* dengan nilai t_{hitung} 2.173917 dan probabilitas 0.0333. Lalu secara simultan *Current Ratio*, *Debt to Equity Ratio* dan *Return on Equity* terhadap *Return Saham* tidak berpengaruh signifikan dengan nilai F_{hitung} 2.269356 dan probabilitas 0.088575. Kemudian nilai koefisien determinasi (R^2) sebesar 0.093507 artinya *Current Ratio*, *Debt to Equity Ratio* dan *Return on Equity* dapat mempengaruhi *Return Saham* sebesar 9%.

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