

ABSTRAK

Skripsi dengan judul “Pengaruh Profitabilitas, *Leverage*, Likuiditas Dan Ukuran Perusahaan Terhadap *Return* Saham (Studi Pada Perusahaan Sektor Keuangan Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Periode Tahun 2018-2020)” ini ditulis oleh Nadia Nusfi Aini FEBI IAIN Tulungagung, NIM. 12403173061, pembimbing Novi Khoirwati. S.E., M.Acc.

Konsumsi dan investasi merupakan dua hal yang saling berkaitan karena setiap orang dihadapkan dengan pilihan tersebut. Konsumsi dibutuhkan untuk kelangsungan hidup seseorang dimasa sekarang, mendatang, dan seterusnya. Dengan kita mengeluarkan uang untuk mengkonsumsi kebutuhan sehari-hari maka kita juga dihadapkan dengan pilihan untuk berinvestasi sebagai komitmen untuk menanamkan jumlah uang atau modal di masa sekarang yang bertujuan untuk memperoleh keuntungan dan kekayaan di masa yang akan datang.

Rumusan masalah penelitian ini yaitu (1) Apakah profitabilitas berpengaruh terhadap *retrun* saham perusahaan sektor keuangan di bursa efek indonesia (2) Apakah *leverage* berpengaruh terhadap *retrun* saham perusahaan sektor keuangan di bursa efek indonesia? (3) Apakah likuiditas berpengaruh terhadap *return* saham perusahaan sektor keuangan di bursa efek indonesia? (4) Apakah ukuran perusahaan berpengaruh terhadap *return* saham perusahaan sektor keuangan di bursa efek indonesia? (5) Bagaimana pengaruh profitabilitas, *leverage*, likuiditas dan ukuran perusahaan terhadap *return* saham sektor keuangan di bursa efek indonesia?.

Penelitian ini menggunakan pendekatan kuantitatif. Data yang digunakan adalah data sekunder. Teknik pengumpulan data menggunakan data perusahaan. Metode analisis data dalam penelitian ini yaitu menggunakan uji hipotesis, uji asumsi klasik.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa (1) profitabilitas berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham. (2) *leverage* berpengaruh negative dan signifikan terhadap *return* saham (3) likuiditas berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham (4) Ukuran Perusahaan tidak berpengaruh positif dan tidak signifikan terhadap *return* saham (5) profitabilitas, *leverage*, likuiditas dan ukuran perusahaan berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham

Kata Kunci: Profitabilitas, *Leverage*, Likuiditas, Ukuran Perusahaan dan

***Return* Saham**

ABSTRACT

Thesis with the title "The Effect of Profitability, Leverage, Liquidity and Company Size on Stock Returns (Study on Financial Sector Companies Listed on the Indonesia Stock Exchange (IDX) 2018-2020)" was written by Nadia Nusfi Aini FEBI IAIN Tulungagung, NIM. 12403173061, supervisor Mr. Novi Khoirwati., S.E., M.Acc

Consumption and investment are two things that are interrelated because everyone is faced with these choices. Consumption is needed for one's survival in the present, future, and so on. By spending money to consume our daily needs, we are also faced with the choice to invest as a commitment to invest the amount of money or capital in the present with the aim of obtaining profits and wealth in the future.

The formulation of the research problem is (1) Does profitability affect the stock returns of Financial Sector companies on the Indonesia Stock Exchange (2) Does leverage affect the stock returns of Financial Sector companies on the Indonesia Stock Exchange? (3) Does liquidity affect stock returns of financial sector companies on the Indonesia Stock Exchange? (4) Does company size affect stock returns of financial sector companies on the Indonesia Stock Exchange? (5) What is the effect of profitability, leverage, liquidit and company size on stock returns of the Financial Sector on the Indonesia Stock Exchange?.

This study uses a quantitative approach. The data used is secondary data. Data collection techniques using company data. The data analysis method in this research is using hypothesis testing, classical assumption test.

The results of this study indicate that (1) profitability has a positive and significant effect on stock returns. (2) leverage has a negative and significant effect on stock returns (3) liquidity has a positive and significant effect on stock returns (4) company size has not significant effect on stock returns (5) profitability, leverage, liquidity and company size have a positive and significant effect on stock returns

Keywords: Profitability, Leverage, Liquidit, Company Size and Stock Returns