

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menguji pengaruh profitabilitas, likuiditas, dan ukuran perusahaan terhadap *return* saham. Pada penelitian ini variabel profitabilitas diukur dengan *return on equity*, variabel likuiditas diukur dengan *current ratio* dan pada variabel ukuran perusahaan menggunakan pengukuran *size*.

Jenis penelitian ini adalah penelitian kuantitatif dengan sampel penelitian yang diperoleh menggunakan metode *purposive sampling*. Berdasarkan hasil penggunaan metode *purposive sampling* didapatkan sebanyak 82 sampel dari 22 perusahaan yang terdaftar dalam indeks LQ-45 selama periode 2019 – 2022. Penelitian ini menggunakan data sekunder yang bersumber dari laporan keuangan dan *annual report*. Teknik analisis data pada penelitian ini dengan menggunakan regresi linier berganda dengan bantuan program SPSS versi 21.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa profitabilitas berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham, likuiditas berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham, sedangkan ukuran perusahaan tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham.

Kata kunci: profitabilitas, likuiditas, ukuran perusahaan, *return* saham



ABSTRACT

This research aimed to examine the effect of profitability, liquidity, and firm size on stock return. The profitability was measured by Return On Equity, liquidity was measured by the Current Ratio, and firm size used Size measurement.

The research was quantitative. Moreover, the data collection technique used purposive sampling. In line with that, there were 82 samples from 22 LQ-45 companies listed during 2019- 2022. Furthermore, the data were secondary in the form of financial statements and annual reports. The data analysis technique used multiple linear regression with SPSS (Statistical Product and Service Solution) 21.

The result showed that profitability had a positive and significant effect on stock return. Likewise, liquidity had a positive and significant effect on stock return. On the other hand, firm size had an insignificant effect on stock return.

Keywords: *profitability, liquidity, firm size, stock return*

