

**ANALISIS FAKTOR-FAKTOR YANG MEMPENGARUHI RETURN
SAHAM PADA PERUSAHAAN PERBANKAN YANG TERDAFTAR DI
BURSA EFEK INDONESIA PERIODE 2018-2020**

Abstrak

Return saham merupakan imbalan dalam bentuk pendapatan yang diterima oleh investor setelah melakukan investasi pada suatu perusahaan, yaitu berupa dividen atau *capital gain*. *Return* saham ini bervariasi tergantung dari lama dan jenis investasi, jika suatu perusahaan menerima pendapatan, maka dana pemilik dalam bentuk saham juga mengalami peningkatan dan sebaliknya apabila suatu perusahaan mengalami kerugian atau kebangkrutan, hat untuk para kreditor menjadi prioritas sehingga nilai saham akan mengalami penurunan. Penelitian ini bertujuan untuk menguji pengaruh variabel *return on equity* (ROE), *price to book value* (PBV), *debt to equity ratio* (DER), *economic value added* (EVA) dan *current ratio* (CR) terhadap *return* saham.

Populasi dalam penelitian ini meliputi seluruh perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2018-2020 sebanyak 46 perusahaan perbankan. Penentuan sampel menggunakan teknik *Purposive Sampling*. Sampel dalam penelitian ini adalah 38 perusahaan perbankan dengan total amatan sebanyak 114. Teknik analisis yang digunakan adalah analisis liner berganda.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa variabel *price to book value* (PBV) dan *current ratio* (CR) berpengaruh positif terhadap *return* saham. Sedangkan *return on equity* (ROE), *price to book value* (PBV) dan *economic value added* (EVA) tidak berpengaruh terhadap *return* saham.

Kata Kunci : *Rasio keuangan, rasio pasar, return on equity, price to book value, debt to equity ratio, economic value added, current ratio, return saham.*