PENGARUH KAPITALISASI PASAR, *DIVIDEND PAYOUT RATIO, EARNING PER SHARE, CURRENT RATIO,* DAN *DEBT TO ASSET RATIO* TERHADAP *RETURN* SAHAM PADA PERUSAHAAN MANUFAKTUR SEKTOR INDUSTRI BARANG KONSUMSI DI BURSA EFEK INDONESIA PERIODE 2018 – 2020

Abstrak

Investor berinvestasi dengan tujuan untuk mendapatkan keuntungan atau return dimasa yang akan datang. Keuntungan dari berinvestasi saham disebut dengan *return* saham. Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui apakah Kapitalisasi Pasar, *Dividend Payout Ratio, Earning Per Share, Current Ratio, dan Debt to Asset Ratio* berpengaruh terhadap *return* saham perusahaan manufaktur sektor industry barang konsumsi yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2018-2020.

Populasi dalam penelitian ini adalah perusahaan manufaktur sektor industri barang konsumsi yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia tahun 2018-2020 melalui situs *www.idx.co.id*. Sampel penelitian ini sebanyak 12 sampel pada perusahaan sektor industri barang konsumsi dengan 36 pengamatan yang ditentukan berdasarkan metode *purposive sampling.* Alat analisis yang digunakan untuk menguji hipotesis adalah Analisis Regresi Linear Berganda.

Hasil Penelitian menunjukan bahwa hanya Kapitalisasi Pasar yang berpengaruh positif terhadap *Return* Saham. *Dividend Payout Ratio, Earning Per Share, Current Ratio, dan Debt to Asset Ratio* tidak berpengaruh terhadap *Return* Saham.. Penelitian selanjutnya dapat mengembangkan penelitian dengan menggunakan variabel lain atau menambah variabel yang relevan terhadap *Return* Saham.

Kata Kunci : Kapitalisasi Pasar, *Dividend Payout Ratio, Earning Per Share, Current Ratio, Debt to Asset Ratio,* dan *Return* Saham.