

ABSTRAK

Riska Nursyfa Fauziah (1178020216): “**Pengaruh Rasio Profitabilitas Dan Rasio Pasar Terhadap Return Saham (Studi Pada Perusahaan Sub Sektor Kosmetik dan Keperluan Rumah Tangga Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Periode 2013-2019)**”

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh rasio profitabilitas dan rasio pasar terhadap *return* saham pada perusahaan sub sektor kosmetik dan keperluan rumah tangga yang terdaftar di bursa efek indonesia pada periode tahun 2013-2019”

Metode penelitian yang digunakan yaitu metode penelitian deskriptif dan verifikatif dengan pendekatan kuantitatif. Pengambilan sampel dengan menggunakan teknik *purposive sampling* yaitu berdasarkan beberapa kriteria yang ditetapkan dengan jumlah sampel yang diteliti sebanyak 7 tahun yang di split menjadi per trisemester. Penelitian ini menggunakan metode data panel, dikarenakan mengambil beberapa perusahaan dalam beberapa periode. Teknik analisis data menggunakan analisis statistik deskriptif, uji asumsi klasik, dan analisis regresi data panel serta uji hipotesis seperti uji parsial (uji t), uji simultan (uji F) dan Koefisien Determinasi (R^2).

Hasil penelitian menunjukkan secara parsial bahwa *Return on Assets* berpengaruh signifikan terhadap *Return Saham* dilihat dari nilai t_{hit} sebesar 2.980981 lebih besar dari t_{tab} sebesar 1,68195 dengan nilai signifikansi 0.0047 lebih kecil dari 0,05. Secara parsial bahwa *Return on Equity* berpengaruh signifikan terhadap *Return Saham* dilihat dari nilai t_{hit} sebesar 2.857142 lebih besar dari t_{tab} sebesar 1,68195 dengan nilai signifikansi 0.0066 lebih kecil dari 0,05. Secara parsial bahwa *Net Profit Margin* tidak berpengaruh signifikan terhadap *Return Saham* dilihat dari nilai t_{hit} sebesar 0.383433 lebih kecil dari t_{tab} sebesar 1,68195 dengan nilai signifikansi 0.7033 lebih besar dari 0,05. Secara parsial bahwa *Earning Per Share* berpengaruh signifikan terhadap *Return Saham* dilihat dari nilai t_{hit} sebesar 3.582867 lebih besar dari t_{tab} sebesar 1,68195 dengan nilai signifikansi 0.0009 lebih kecil dari 0,05. Secara parsial bahwa *Price Earning Ratio* berpengaruh signifikan terhadap *Return Saham* dilihat dari nilai t_{hit} sebesar 2.300533 lebih besar dari t_{tab} sebesar 1,68195 dengan nilai signifikansi 0.0263 lebih kecil dari 0,05. Sedangkan secara simultan *Return on Assets*, *Return on Equity*, *Net Profit Margin*, *Earning Per Share* dan *Price Earning Ratio* berpengaruh terhadap *Return Saham* dilihat dari nilai f_{hit} sebesar 4.391247 lebih besar dari f_{tab} sebesar 2,42. Selain itu, nilai koefisien determinasi (R^2) dengan menggunakan *Random Effect Model* adalah sebesar 0.338016. Hal ini berarti bahwa variabel independen yang diteliti dapat menjelaskan variabel dependen sebesar 33%.

Kata Kunci: *Return on Assets (ROA)*, *Return on Equity (ROE)*, *Net Profit Margin (NPM)*, *Earning Per Share (EPS)*, *Price Earning Ratio (PER)*, *Return Saham*