

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk meneliti secara empiris mengenai pengaruh rentabilitas, likuiditas, dan nilai pasar terhadap *return* saham pada perusahaan subsektor property dan real estate yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2009-2013.

Teknik sampling yang digunakan dalam penelitian ini adalah purposive sampling dengan kriteria: perusahaan subsektor property dan real estate yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia, mempublikasikan laporan keuangan lima tahun berturut-turut sejak tahun 2009-2013 dan berakhir setiap 31 Desember. Sampel yang diperoleh yaitu sebanyak 34 perusahaan. Teknik analisa yang digunakan adalah uji asumsi klasik, regresi, korelasi, koefisien determinasi sedangkan uji hipotesis yang digunakan adalah uji t dan uji F dengan bantuan SPSS.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa variabel rentabilitas tidak berpengaruh terhadap *return* saham. Sedangkan likuiditas dan nilai pasar berpengaruh terhadap *return* saham. Hasil uji simultan menunjukkan rentabilitas, likuiditas, dan nilai pasar berpengaruh terhadap *return* saham. Hasil penelitian ini diharapkan dapat menjadi pedoman baik oleh pihak perusahaan dan bagi peneliti selanjutnya.

Kata kunci : Rentabilitas, Likuiditas, Nilai Pasar, *Return* Saham