

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh Likuiditas, Profitabilitas, Solvabilitas terhadap *Return Saham*. Studi pada Perusahaan Pertambangan Sub Sektor Batu Bara yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2011-2015).

Teknik sampling yang digunakan dalam penelitian ini adalah *purposive sampling* dengan kriteria: (1) Perusahaan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (2) memiliki data yang terkait dengan variabel-variabel yang digunakan dalam penelitian. Sehingga jumlah sampel yang diperoleh sebanyak 10 perusahaan.

Pendekatan penelitian yang digunakan dalam penelitian ini adalah analisis deskriptif dan verifikatif. Analisis statistik yang digunakan dalam penelitian ini adalah uji asumsi klasik, analisis regresi berganda, analisis korelasi, serta pengujian hipotesis uji *t* dan uji *F*, koefisien determinasi, dan pengolahan data dibantu dengan *software SPSS v25*.

Hasil uji statistik secara parsial menunjukkan bahwa Likuiditas berpengaruh terhadap *Return Saham* sebesar 19,2%. Profitabilitas berpengaruh terhadap *Return Saham* sebesar 34,5%. Solvabilitas berpengaruh terhadap *Return Saham* sebesar 30,1%. Sedangkan secara simultan hasil penelitian menunjukkan bahwa terdapat pengaruh antara Likuiditas, Profitabilitas, Solvabilitas terhadap *Return Saham* sebesar 83,8%.

Kata Kunci: Likuiditas, Profitabilitas, Solvabilitas, dan *Return Saham*

ABSTRACT

This study aims to determine the effect of Liquidity, Profitability, Solvability on Stock Returns. Study of the Coal Mining Sub Sector Company listed on the Indonesia Stock Exchange in 2011-2015).

The sampling technique used in this study was purposive sampling with criteria: (1) Companies listed on the Indonesia Stock Exchange (2) have data related to the variables used in the study. So that the number of samples obtained is 10 companies.

The research approach used in this study is descriptive and verification analysis. The statistical analysis used in this study is the classical assumption test, multiple regression analysis, correlation analysis, coefficient of determination, and testing of the hypothesis t test and F test and data processing assisted with SPSS v25 software.

The results of the partial statistical test show that liquidity has an effect on Stock Returns of 19.2%. Profitability has an effect on Stock Returns of 34.5%. Solvency has an effect on Stock Returns of 30.1%. While simultaneously the results of the study indicate that there is an influence between Liquidity, Profitability, Solvency to Stock Returns of 83.8%.

Keywords: *Liquidity, Profitability, Solvability, and Stock Return*