

ABSTRAK

Viola Vallentine Hasyim (01012180087)

PENGARUH *NET PROFIT MARGIN*, *RETURN ON EQUITY*, *RETURN ON ASSETS*, DAN *EARNINGS PER SHARE* TERHADAP *RETURN SAHAM* PERUSAHAAN MANUFAKTUR SEKTOR INDUSTRI BARANG KONSUMSI

(xv + 70 halaman: 1 gambar; 10 tabel; 3 lampiran)

Penelitian ini dilakukan untuk membahas mengenai pengaruh rasio keuangan terhadap *return* saham perusahaan, khususnya perusahaan manufaktur sektor industri barang konsumsi. Rasio keuangan yang digunakan dalam penelitian ini adalah *Net Profit Margin* (NPM), *Return On Equity* (ROE), *Return On Assets* (ROA) dan *Earnings Per Share* (EPS) sebagai variabel independen. Variabel terikat yang digunakan dalam penelitian ini adalah *Return Saham*, sedangkan variabel kontrol yang digunakan adalah Ukuran Perusahaan (*Firm Size*) dan Pertumbuhan Penjualan (*Growth Sales*). Sampel data yang digunakan dalam penelitian ini menggunakan perusahaan manufaktur sektor industri barang konsumsi yang terdaftar dalam Bursa Efek Indonesia (BEI) dengan periode pengamatan selama 10 tahun (2011-2020). Sebanyak 30 perusahaan diambil menggunakan metode *non-probability sampling* atau *purposive sampling*. Dengan demikian, total data yang digunakan adalah sebanyak 213 (adanya kriteria tambahan). Metode analisis yang digunakan adalah metode analisis regresi linier berganda. Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwa (1) *Net Profit Margin* (NPM) berpengaruh negatif signifikan terhadap *Return Saham*, (2) *Return On Equity* (ROE) berpengaruh positif signifikan terhadap *Return Saham*, dan (3) *Return On Assets* (ROA) berpengaruh positif signifikan terhadap *Return Saham*, dan (4) *Earnings Per Share* (EPS) berpengaruh negatif tidak signifikan terhadap *Return Saham*.

Kata kunci: *Net Profit Margin*, *Return On Equity*, *Return On Assets*, *Earnings Per Share*, Ukuran Perusahaan, Pertumbuhan Penjualan, *Return Saham*.

ABSTRACT

Viola Vallentine Hasyim (01012180087)

THE INFLUENCE OF NET PROFIT MARGIN, RETURN ON EQUITY, RETURN ON ASSETS, AND EARNINGS PER SHARE ON STOCK RETURNS OF MANUFACTURING COMPANIES IN THE CONSUMER GOODS INDUSTRY SECTOR

(xv + 70 pages: 1 image; 10 tables; 3 attachments)

This study was conducted to discuss the effect of financial ratios on company's stock returns, especially manufacturing companies in the consumer goods industry sector. The financial ratios used in this study are Net Profit Margin (NPM), Return On Equity (ROE), Return On Assets (ROA) and Earnings Per Share (EPS) as independent variables. The dependent variable used in this study is stock returns, while the control variables used are firm size and growth sales. The data sample used in this study uses manufacturing companies in the consumer goods industry sector listed on the Indonesia Stock Exchange (IDX) with an observation period of 10 years (2011-2020). A total of 30 companies were selected using the non-probability sampling method or purposive sampling. Thus, the total data used is 213 (there are additional criteria). The analytical method used is multiple linear regression analysis method. The results of this study indicate that (1) Net Profit Margin (NPM) has a significant negative effect on Stock Returns, (2) Return On Equity (ROE) has a significant positive effect on Stock Returns, and (3) Return On Assets (ROA) has a significant positive effect on Stock Returns, and (4) Earnings Per Share (EPS) has an insignificant negative effect on Stock Returns.

Keywords: Net Profit Margin, Return On Equity, Return On Assets, Earnings Per Share, Company Size, Sales Growth, Stock Returns.