

ABSTRAK

**ANALISIS *LEVERAGE*, *PROFIT MARGIN* DAN *FIRM SIZE*
TERHADAP *STOCK RETURN* PERUSAHAAN MANUFAKTUR
YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK INDONESIA (BEI)
(Survey Pada Perusahaan Manufaktur yang
Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia)**

Oleh:

BHALGYST PUTRI UTAMI

153403010

Pembimbing:

**Dr. H. Dedi Kusmayadi, S.E., M.Si., Ak., CA.
Rina Marlina, S.Pd., M.Sc.**

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh *Leverage*, *Profit Margin* dan *Firm Size* terhadap *Stock Return* pada perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2014-2018. Populasi dalam penelitian ini adalah seluruh perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia sebanyak 144 perusahaan. Setelah melewati tahap *purposive sampling*, jumlah sampel yang layak digunakan yaitu sebanyak 58 perusahaan.

Metode analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah Regresi Linear Data Panel. Dengan melakukan pemilihan model dengan Uji Chow, Uji Housman dan Uji Lagrange kemudian terpilih model regresi *Common Effect Model*. Pengujian hipotesis menggunakan uji T dan uji F.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa secara parsial *Leverage* dan *Profit Margin* tidak berpengaruh signifikan terhadap *Stock Return*. Sedangkan *Firm Size* berpengaruh signifikan terhadap *Stock Return*. *Simultan Leverage, Profit Margin* dan *firm Size* berpengaruh secara signifikan terhadap *Stock Return*.

Kata Kunci: *Leverage, Profit Margin, Firm Size, Stock Return*.