

ABSTRAK

Penelitian ini dilakukan untuk memahami bagaimana pengaruh *Return On Asset*, *Return On Equity*, *Current Ratio*, *Debt to Equity Ratio* dan Ukuran Perusahaan terhadap *Return Saham*. Penelitian ini merupakan penelitian kuantitatif yang dilakukan pada perusahaan manufaktur yang terdaftar di BEI pada industri makanan dan minuman. Penelitian ini menggunakan data sekunder berupa data panel periode tahun 2020-2023. Besar sampel yang diambil dari populasi 96 emiten adalah 33 emiten dengan menggunakan metode *purposive sampling*. Cara pengumpulan data dalam penelitian ini adalah melalui dokumentasi, yaitu data berupa laporan keuangan perusahaan. Analisis data dilakukan dengan analisis regresi linear berganda. *Output* penelitian membuktikan ROA tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham dengan nilai signifikansi $0,7093 > 0,05$, ROE tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham dengan nilai signifikansi $0,9012 > 0,05$, CR tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham dengan nilai signifikansi $0,7268 > 0,05$, DER berpengaruh signifikan terhadap *return* saham dengan nilai signifikansi $0,0128 < 0,05$ dan Ukuran Perusahaan berpengaruh signifikan terhadap *return* saham dengan nilai signifikansi $0,0088 < 0,05$.

Kata Kunci: *Return On Asset*, *Return On Equity*, *Current Ratio*, *Debt to Equity Ratio*, Ukuran Perusahaan dan *Return Saham*

ABSTRAC

The research was conducted to understand the influence of Return On Assets, Return On Equity, Current Ratio, Debt to Equity Ratio and Firm Size on Stock Returns. This research conducted on manufacturing companies listed on the IDX in the food and beverage industry. This research uses secondary data in the form of panel data for the 2020-2023 period. The sample size taken from a population of 96 issuers was 33 issuers using the purposive sampling method. The method of collecting data in this research is through documentation, namely data in the form of company financial reports. Data analysis was carried out using multiple linear regression analysis. The research output proves that ROA has no significant effect on stock returns with a significance value of $0.7093 > 0.05$, ROE has no significant effect on stock returns with a significance value of $0.9012 > 0.05$, CR has no significant effect on stock returns with a significance value of $0.7268 > 0.05$, DER has significant effect on stock returns with a significance value of $0.0128 < 0.05$ and Firm Size has significant effect on stock returns with a significance value of $0.0088 < 0.05$.

Keywords: Return On Assets, Return On Equity, Current Ratio, Debt to Equity Ratio, Firm Size and Stock Returns