

ABSTRAK

Latar Belakang : Salah satu indikator penting dalam suatu perusahaan ialah *return* saham, hal tersebut menunjukkan seberapa besar ketertarikan investor dalam menginvestasikan dananya pada suatu perusahaan. Melalui penelitian ini akan dilakukan pengukuran pada rasio *Return on Asset*, *Return on Equity*, *Loan to Deposit Ratio*, *Capital Adequacy Ratio*, dan *Non Performing Loan*. Modal, kualitas kredit, likuiditas, laba (rentabilitas) dapat menjadi salah satu faktor penentu *return* saham perusahaan perbankan. Namun, pada praktiknya ada perusahaan perbankan yang memiliki kinerja yang kurang baik tetapi mengalami kenaikan saham yang tinggi. Hal ini menunjukkan bahwa walaupun ROA, ROE, LDR, CAR, dan NPL perusahaan baik namun tetap mengalami penurunan *return* saham. Maka dari itu, penulis ingin mengetahui seberapa besar signifikan pengaruh ROA, ROE, LDR, CAR, dan NPL terhadap *Return Saham* secara simultan dan parsial. **Tujuan :** Untuk memperoleh bukti empiris mengenai pengaruh *Return on Asset*, *Return on Equity*, *Loan to Deposit Ratio*, *Capital Adequacy Ratio*, dan *Non Performing Loan* terhadap *return* saham.

Metode Penelitian : Penulis menggunakan metode penelitian kuantitatif dengan teknik *purposive sampling* sebanyak 5 perusahaan dengan periode 4 tahun, total sampel yang digunakan pada penelitian ini sebanyak 20 sampel. Teknik analisa data yang digunakan adalah kuantitatif deskriptif dan kuantitatif verifikatif.

Hasil: Terdapat pengaruh secara positif signifikan antara *Return on Asset*, *Return on Equity* dan ada pengaruh secara negatif signifikan antara *Non Performing Loan* terhadap *return* saham perusahaan perbankan terdaftar Indeks LQ45 periode tahun 2016-2019. Sedangkan tidak ada pengaruh signifikan antara *Capital Adequacy Ratio* dan *Loan to Deposit Ratio* terhadap *return* saham perusahaan perbankan terdaftar Indeks LQ45 periode tahun 2016-2019.

Kata Kunci : *Return on Asset*, *Return on Equity*, *Loan to Deposit Ratio*, *Capital Adequacy Ratio*, *Non Performing Loan*, dan *Return Saham*