ABSTRAK

Return saham adalah keuntungan bagi investor yang diperoleh dari kepemilikan saham investor atas investasi yang dilakukannya, yang terdiri dari dividen dan *capital gain/loss*. Nilai *return* saham mencerminkan estimasi keuntungan yang lebih akurat bagi investor. Pada investasi saham, investor akan memilih perusahaan yang memiliki prospek cemerlang dengan tingkat keuntungan yang tinggi. *Return* saham dapat memberikan nilai dari suatu investasi yang dilakukan. Namun, tingkat *return* saham dapat berfluktuasi seiring berjalannya waktu dan hal tersebut dapat dipicu dari beberapa faktor, baik faktor internal maupun eksternal perusahaan.

Penelitian ini bertujuan untuk memberikan penjelasan bagaimana pengaruh dari masing-masing variabel profitabilitas, *leverage*, dan *earnings per share* terhadap *return* saham baik secara simultan maupun secara parsial. Fenomena dalam penelitian ini merupakan hasil dari pengamatan studi kasus terhadap objek penelitian. Data yang digunakan pada penelitian ini merupakan data sekunder yang bersumber dari laporan keuangan tahunan perusahaan dari periode 2017 sampai 2020.

Populasi pada penelitian ini merupakan sektor transportasi yang terdaftar dalam Bursa Efek Indonesia dan termasuk dalam Indeks Sektoral Transportasi dan Logistik periode 2017-2020. Teknik pengambilan data yang dilakukan dalam penelitian ini adalah *purposive sampling* berdasarkan kriteria tertentu yang telah ditetapkan oleh peneliti dengan jumlah sampel sebanyak 17 perusahaan. Data yang telah diperoleh dalam penelitian ini kemudian diolah dengan aplikasi statistik *EViews 10.*

Berdasarkan hasil penelitian profitabilitas (ROE), *leverage* (DER) dan *earnings per share* (EPS) memiliki pengaruh signifikan secara simultan terhadap *return* saham pada sektor transportasi dan logistik yang terdaftar di Indeks Sektoral tahun 2017-2020. Kemudian, secara parsial *leverage* berpengaruh terhadap *return* saham pada perusahaan sektor transportasi dan logistik yang terdaftar di Indeks Sektoral tahun 2017-2020. Sedangkan, profitabilitas dan *earnings per share* tidak berpengaruh terhadap *return* saham pada perusahaan sektor transportasi dan logistik yang terdaftar di Indeks Sektoral tahun 2017-2020.

Hasil penelitian memberikan estimasi serta gambaran mengenai kinerja perusahaan dalam memberikan manfaat bagi para *shareholders.* Selain itu, penelitian ini diharapkan dapat dijadikan sebagai bahan evaluasi bagi perusahaan agar dapat mengelola liabilitas se-efisien mungkin. Kemudian, penelitian ini diharapkan membantu investor dalam pengambilan keputusan berinvestasi.

Kata kunci: *Return* saham, profitabilitas, *leverage*, *earning per share*