

ABSTRAK

Kholis Hidayah, 1420210222, Pokok permasalahan dalam penelitian ini adalah bagaimana individu atau perusahaan sebelum melakukan investasi saham, harus memastikan bahwa investasi yang dilakukan adalah tepat. Dengan menerapkan berbagai cara penilaian apakah saham yang dipilih benar-benar merupakan saham yang akan memberikan keuntungan di waktu yang akan datang. Tujuan penelitian ini untuk mengetahui Pengaruh *Return On Equity* (ROE), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Current Ratio* (CR) terhadap *Return Saham* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (Studi kasus pada PT Unilever Indonesia Tbk periode 2007-2016) Skripsi, Jurusan Ekonomi dan Bisnis Islam, Prodi Ekonomi Syariah, IAIN Kudus, 2019.

Penelitian ini bertujuan untuk menguji pengaruh *return on equity* (ROE) terhadap *Return* saham, pengaruh *debt to equity ratio* (DER) terhadap *return* saham, dan pengaruh *current ratio* (CR) terhadap *return* saham.

Jenis penelitian ini tergolong penelitian kuantitatif. Adapun sumber data penelitian ini adalah data sekunder. Populasi dalam penelitian ini adalah PT Unilever Indonesia periode 2007-2016. Teknik pengambilan sampel pada penelitian ini diperoleh dengan teknik *purposive sampling*. Teknik pengumpulan data yang di gunakan adalah dokumentasi. Data yang digunakan adalah laporan keuangan tahun 2007-2016 yang telah di publikasikan di dalam Indonesia Capital Market Directory (ICMD). Analisis data dilakukan dengan analisis regresi berganda. Selanjutnya pengujian hipotesis menggunakan koefisien determinasi, uji t dan uji F yang di analisis menggunakan program SPSS 16.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa secara parsial, variabel *Return On Equity* (ROE) tidak berpengaruh secara signifikan terhadap *return* saham pada perusahaan Unilever karena memiliki nilai signifikansi sebesar 0,636, dimana nilai signifikansi lebih besar dari nilai alpha 0,05; *Debt to Equity Ratio* (DER) memiliki pengaruh yang signifikan terhadap *return* saham pada perusahaan Unilever, karena memiliki nilai signifikansi sebesar 0,044, di mana nilai signifikansi lebih kecil dari nilai alpha 0,05; variabel *Current Ratio* (CR) berpengaruh secara signifikan terhadap *return* saham perusahaan Unilever, karena memiliki nilai signifikansi sebesar 0,043, dimana nilai signifikan lebih kecil dari nilai alpha 0,05. Namun, berdasarkan pengujian secara simultan, variabel ROE, DER dan CR berpengaruh signifikan terhadap *return* saham perusahaan Unilever karena memiliki nilai signifikansi sebesar 0,031, di mana nilai signifikan lebih kecil dari nilai alpha 0,05. Berdasarkan nilai koefisien determinasi, variabel ROE, DER dan CR dapat menjelaskan variabel *return* saham pada perusahaan Unilever Indonesia periode 2007-2016 sebesar 30.5%, sedangkan sisanya 69.5% dijelaskan oleh variabel lain yang tidak diajukan dalam penelitian ini.

Kata Kunci : *Return On Equity* (ROE), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Current Ratio* (CR) dan *Return Saham*.