

ABSTRAK

Studi ini meneliti *stock split*, variabel-variabel pasar keuangan, *Economic Value Added* (EVA) emiten yang kemungkinan memiliki dampak terhadap *return saham*. Variabel pasar keuangan berupa: *Earning per Share* (EPS), *Trading Volume Activity* (TVA), kapitalisasi pasar, dan *dividend yield*. Data 41 perusahaan terbuka yang melakukan aksi korporasi dikumpulkan berdasarkan dari laporan keuangan, laporan tahunan dan laboratorium bloomberg dalam kurun waktu lima tahun yaitu 2017-2021.

Perangkat lunak IBM SPSS Statistic 21 digunakan untuk meneliti hubungan antara variabel: aksi korporasi, variabel pasar keuangan, *Economic Value Added* (EVA) emiten yang kemungkinan memiliki dampak terhadap *return saham*. Hasil menunjukkan bahwa sebagian besar variabel pasar keuangan tidak memiliki pengaruh terhadap *return* saham, terkecuali *Earning per Share* yang memiliki pengaruh positif signifikan terhadap *return* saham. Dari studi ini diperoleh variabel yang digunakan dan hanya mampu menjelaskan 21,6% faktor yang dapat memengaruhi *return* saham sehingga masih terdapat 78,4% aspek lainnya yang dapat diteliti lebih lanjut.

Berdasarkan hasil pembahasan dan kesimpulan, maka terdapat saran sebagai berikut: (1) Melakukan penelitian dengan sampel emiten dari sektor tertentu. (2) Menambahkan variabel lainnya yang mampu menjelaskan pengaruh dengan *return* saham. (3) Penelitian pada masa yang akan datang sebaiknya memerhatikan faktor risiko pasar.

Kata kunci: *Stock Split*, Variabel Pasar Keuangan, EVA