

ABSTRAK

Penelitian ini berupaya mempelajari beberapa rasio keuangan yang dapat dijadikan alat prediksi singkat pengembalian investasi. Objek penelitian yang digunakan dalam penelitian ini adalah perusahaan yang tergabung dalam LQ 45 selama periode penelitian 2010-2013. Variabel-variabel yang diteliti adalah Profitabilitas dan Solvabilitas. Teknik analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah regresi linear berganda.

Penelitian ini dilakukan dengan metode kuantitatif terhadap laporan keuangan perusahaan yang terdaftar dalam LQ 45 selama periode 2009-2010. Total sampel penelitian adalah 19 perusahaan, yang ditentukan melalui metode purposive sampling. Metode pengujian hipotesis menggunakan uji beda t-test dan regresi linear berganda.

Hasil penelitian sejalan dengan hasil penelitian yang dilakukan oleh Yeye (2011). Hasil penelitian ini menunjukkan ada pengaruh positif antara Gross Profit Margin (GPM), Net Profit Margin (NPM), Return On Asset (ROA), Return On Equity (ROE), dan Debt To Equity (DER) terhadap return saham perusahaan yang terdaftar dalam LQ 45 di Bursa Efek Indonesia selama periode 2010-2013.

Kata kunci: Profitabilitas, Solvabilitas, LQ45 dan Return Saham