

**SKRIPSI**

**PROFITABILITAS DAN LIKUIDITAS SEBAGAI  
PREDIKTOR STOCK RETURN PADA PERUSAHAAN  
KAPITALISASI PASAR TERBESAR DI BURSA EFEK  
INDONESIA PADA PERIODE 2013-2017**



**UNTAR**  
Universitas Tarumanagara

**DIAJUKAN OLEH**

**NAMA : CENTIA LUCIANA ROSA**

**NPM : 115150093**

**UNTUK MEMENUHI SEBAGIAN DARI SYARAT - SYARAT  
GUNA MENCAPAI GELAR SARJANA EKONOMI**

**PROGRAM STUDI SI MANAJEMEN  
FAKULTAS EKONOMI UNIVERSITAS  
TARUMANAGARA JAKARTA 2019**

**UNIVERSITAS TARUMANAGARA**  
**FAKULTAS EKONOMI**  
**JAKARTA**

**HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI**

NAMA : CENTIA LUCIANA ROSA  
NIM : 115150093  
PROGRAM/JURUSAN : S1 / MANAJEMEN  
KONSENTRASI : MANAJEMEN KEUANGAN  
JUDUL SKRIPSI : PROFITABILITAS DAN LIKUIDITAS SEBAGAI  
PREDIKTOR *STOCK RETURN* PADA  
PERUSAHAAN KAPITALISASI PASAR TERBESAR  
DI BURSA EFEK INDONESIA PADA PERIODE  
2013-2017.

Jakarta, 1 Juli 2019

Pembimbing,



Hendra Wiyanto, S.E., M.E.

UNIVERSITAS TARUMANAGARA  
FAKULTAS EKONOMI  
JAKARTA

HALAMAN PENGESAHAN SKRIPSI

NAMA : CENTIA LUCIANA ROSA  
NIM : 115150093  
PROGRAM/JURUSAN : S1 / MANAJEMEN  
KONSENTRASI : MANAJEMEN KEUANGAN  
JUDUL SKRIPSI : PROFITABILITAS DAN LIKUIDITAS SEBAGAI  
PREDIKTOR *STOCK RETURN* PADA  
PERUSAHAAN KAPITALISASI PASAR TERBESAR  
DI BURSA EFEK INDONESIA PADA PERIODE  
2013-2017.

Tanggal: 1 Juli 2019

Ketua Pembimbing

Tanggal: 1 Juli 2019

  
(Dr. Sarwo Edy Handoyo, S.E., M.M.)

Anggota Pembimbing

Tanggal: 1 Juli 2019

  
(Hendra Wiyanto, S.E., M.E.)

Anggota Pembimbing

  
(I Gede Adiputra Drs., M.M., Dr.)

## ABSTRAK

UNIVERSITAS TARUMANAGARA

FAKULTAS EKONOMI

JAKARTA

(A) CENTIA LUCIANA ROSA (115150093)

(B) PROFITABILITAS DAN LIKUIDITAS SEBAGAI PREDIKTOR  
*STOCK RETURN* PADA PERUSAHAAN KAPITALISASI PASAR  
TERBESAR DI BURSA EFEK INDONESIA PADA PERIODE 2013-  
2017

(C) Xv+ 107 Halaman, 2019, 13 tabel, 1 gambar, 7 lampiran

(D) MANAJEMEN KEUANGAN

(E) **Abstrak:** Tujuan dari penelitian ini adalah untuk menentukan profitabilitas, dan likuiditas sebagai prediktor pengembalian saham. Populasi dalam penelitian ini adalah perusahaan kapitalisasi pasar terbesar di Bursa Efek Indonesia (BEI) pada 2013-2017. Sampel yang digunakan terdiri dari 59 perusahaan kapitalisasi pasar. Metode pengambilan sampel menggunakan teknik purposive sampling. Analisis dilakukan dengan menggunakan Analisis Regresi Panel Data dengan metode Common Effect dalam menguji hipotesis. Hasil menunjukkan bahwa laba per saham adalah prediktor negatif pengembalian saham. Pengembalian aset adalah prediktor positif pengembalian saham. Rasio cepat adalah prediktor positif pengembalian saham.

**Kata Kunci:** Profitabilitas, Likuiditas, *Stock Return*, *Return on Asset*, *Earning Per Share*, dan *Quick Ratio*

(F) Daftar Pustaka: 28 (1998-2017)

(G) Hendra Wiyanto S.E., M.E.

**ABSTRACT**

**TARUMANAGARA UNIVERSITY**

**FACULTY OF ECONOMY**

**JAKARTA**

(A) CENTIA LUCIANA ROSA (115150093)

(B) PROFITABILITY AND LIQUIDITY AS STOCK RETURN

PREDICTORS IN THE LARGEST MARKET CAPITALIZATION

COMPANIES IN INDONESIA STOCK EXCHANGE IN THE 2013-

2017 PERIOD

(C) *Xv+ 107 Pages, 2019, tabels 13, pictures 1, Attachments 7*

(D) FINANCE MANAGEMENT

**Abstract:** The purpose of this study was to determine profitability, and liquidity as predictors of stock returns. The population in this study is the largest market capitalization company on the Indonesia Stock Exchange (IDX) in 2013-2017. The sample used consisted of 59 market capitalization companies. The sampling method uses purposive sampling technique. The analysis is done by using Data Panel Regression Analysis with the Common Effect method in testing the hypothesis. The results show that earnings per share is a negative predictor of stock returns. Return on assets is a positive predictor of stock returns. Quick ratio is a positive predictor of stock returns.

**Key Words:** *profitability, Liquidity, earning per share, return on assets, quick ratio, stock return.*

(E) References List: 28 (1998-2017)

(F) Hendra Wiyanto S.E., M.E.