

ABSTRAK

Return saham merupakan hasil yang diperoleh dari investasi yang dilakukan oleh investor. Pertumbuhan sektor pertambangan terus mengalami penurunan, hal tersebut dapat dilihat dari pertumbuhan ekspor dan *return* saham yang dihasilkan oleh sektor pertambangan pada tahun 2011-2015 tumbuh negatif. Perolehan laba yang dihasilkan oleh perusahaan akan berdampak pada tingkat *return* saham yang dihasilkan oleh perusahaan yang nantinya akan diberikan kepada investor.

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui bagaimana profitabilitas, *leverage*, ukuran perusahaan, dan *return* saham pada perusahaan sektor pertambangan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia tahun 2011-2015. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui bagaimana pengaruh profitabilitas, *leverage*, dan ukuran perusahaan baik secara simultan maupun parsial terhadap *return* saham pada perusahaan sektor pertambangan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia tahun 2011-2015.

Berdasarkan tujuannya, penelitian ini merupakan penelitian deskriptif verifikatif bersifat kausalitas dan termasuk dalam penelitian kuantitatif. Teknik pengambilan sampel yang digunakan pada penelitian ini adalah teknik *purposive sampling* yang memperoleh 9 sampel penelitian dalam kurun waktu 5 tahun sehingga di dapat 45 unit sampel perusahaan sektor pertambangan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia pada tahun 2011-2015. Metode analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah analisis regresi data panel dengan menggunakan *software Eviews 9*.

Berdasarkan hasil penelitian menunjukkan bahwa profitabilitas, *leverage*, dan ukuran perusahaan secara simultan berpengaruh terhadap *return* saham. Secara parsial *leverage* dan ukuran perusahaan berpengaruh positif terhadap *return* saham, sedangkan profitabilitas secara parsial tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham.

Dari hasil penelitian ini diharapkan menjadi informasi untuk mengambil keputusan bagi investor dalam berinvestasi pada sektor pertambangan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia dimasa yang akan datang. Bagi perusahaan penelitian ini diharapkan menjadi informasi untuk memperbaiki kinerja keuangan perusahaan yang dapat mempengaruhi *return* saham.

Kata Kunci: Profitabilitas, *Leverage*, Ukuran Perusahaan, *Return* Saham