

ABSTRACT

Wahyu Kusuma Wijaya, The Effect of Fundamental and Technical Variables on the Return of Banking Stocks Listed on the Indonesia Stock Exchange (IDX) for the 2017-2021 Period. Under the guidance of Prasetyo Nugroho, S.Pi., M.M.

The purpose of this study is to determine whether fundamental and technical variables have an effect either partially or simultaneously on stock returns in banking companies listed on the Indonesia Stock Exchange (IDX) for the 2017-2021 period. This research was conducted in a quantitative descriptive manner using secondary data obtained from the financial statements of the Indonesia Stock Exchange (IDX). The population selected in this study were 47 companies banking companies, the sample was selected using purposive sampling method and obtained 30 companies that meet the criteria. The variables used in this study are EPS, DER, CR, TVA and stock prices as independent variables, stock returns as the dependent variable.

Hypothesis testing in this study used t test (partial), F test (simultaneous) with SPSS (statistical product and service solutions) application tools. The results of this study prove that: (1) The results of fundamental analysis testing which include indicators of EPS, DER and CR indicate that the fundamental variables have no significant negative effect on stock returns (2) The results of technical analysis tests which include indicators of Stock Trading Volume (TVA) and Price Stocks show that technical variables have a positive and insignificant effect on stock returns. (3) Simultaneous test results show that EPS, DER, CR, Stock Trading Volume (TVA) and Stock Prices simultaneously have no significant effect on stock returns.

Keywords: *EPS, DER, CR, TVA, Stock Price, Stock Return*

ABSTRAK

Wahyu Kusuma Wijaya, Pengaruh Variabel Fundamental Dan Teknikal Terhadap Return Saham Perbankan Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia (BEI) Periode 2017-2021. Di bawah bimbingan Prasetyo Nugroho, S.Pi., M.M.

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui apakah variabel fundamental dan teknikal berpengaruh baik secara parsial maupun simultan terhadap return saham pada perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2017-2021. Penelitian ini dilakukan secara deskriptif kuantitatif dengan menggunakan data sekunder yang diperoleh dari laporan keuangan Bursa Efek Indonesia (BEI). Populasi yang dipilih dalam penelitian ini adalah perusahaan perbankan sebanyak 47 perusahaan, sampel dipilih dengan menggunakan metode *purposive sampling* dan diperoleh 30 perusahaan yang memenuhi kriteria. Variabel yang digunakan dalam penelitian ini adalah EPS, DER, CR, TVA dan Harga Saham sebagai variabel bebas, return saham sebagai variabel terikat.

Pengujian hipotesis pada penelitian ini menggunakan uji t (parsial), uji F (simultan) dengan alat bantu aplikasi SPSS (*statistical product and service solutions*). Hasil penelitian ini membuktikan bahwa: (1) Hasil pengujian analisis fundamental yang meliputi indikator EPS, DER dan CR menunjukkan bahwa variabel fundamental berpengaruh negatif tidak signifikan terhadap return saham (2) Hasil pengujian analisis teknikal yang meliputi indikator Volume Perdagangan Saham (TVA) dan Harga Saham menunjukkan bahwa variabel teknikal berpengaruh positif tidak signifikan terhadap return saham (3) Dari hasil pengujian secara simultan, menunjukkan hasil bahwa EPS, DER, CR, Volume Perdagangan Saham (TVA) dan Harga Saham secara simultan tidak memiliki pengaruh signifikan terhadap return saham.

Kata kunci: EPS, DER, CR, TVA, Harga Saham, Return Saham