**ABSTRAK**

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh kinerja keuangan, ukuran perusahaan dan produk domestik bruto terhadap *abnormal return* saham. Kinerja keuangan diukur dengan proksi likuiditas (*CR),* profitablitas (*ROE), earning per share, leverage (DER),* nilai pasar (*MBR).* Objek penelitian ini yaitu perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia pada tahun 2016-2020, dan pengambilan sampel menggunakan teknik *purposive sampling* sehingga memperoleh sampel penelitian sebanyak 114 perusahaan manufaktur. Teknik analisis pada penelitian ini menggunakan analisis regresi linier berganda. Hasil penelitian menunjukkan bahwa likuiditas (*CR*), *earning per share, leverage (DER),* nilai pasar *(MBR),* ukuran perusahaantidak berpengaruh terhadap *abnormal return.* Profitabilitas *(ROE)* berpengaruh positif terhadap *abnormal return,* sedangkan produk domestik bruto berpengaruh negatif terhadap *abnormal return.*

**Kata Kunci :** Kinerja Keuangan, Ukuran Perusahaan, Produk Domestik Bruto, *Abnormal Return*