Here is the list of US states which are feminine in French (because they end with an “e”):  
La Floride, la Californie, la Caroline du Sud, la Caroline du Nord, la Louisiane, la Georgie, la Virginie-Occidentale (West Virginia), la Virginie (Virginia), la Pennsylvanie.  
But watch out for the exception: le Maine.

Note that “l’Arkansas” and “le Texas” are masculine singular, although they end with an “s” (which is pronounced for both states).

Here is a list of US states with the appropriate preposition to say you are “in” or going “to” these states:

1. en Alabama
2. en Alaska
3. en Arizona
4. en Arkansas
5. en Californie
6. en Caroline du Nord
7. en Caroline du Sud
8. dans le Colorado / au Colorado
9. dans le Connecticut / au Connecticut
10. dans le Dakota du Nord
11. dans le Dakota du Sud
12. dans le Delaware / au Delaware
13. en Floride
14. en Géorgie
15. à Hawaï
16. en Idaho
17. en Illinois
18. en Indiana
19. en Iowa
20. dans le Kansas / au Kansas
21. dans le Kentucky / au Kentucky
22. en Louisiane
23. dans le Maine
24. dans le Maryland / au Maryland
25. dans le Massachusetts / au Massachusetts
26. dans le Michigan / au Michigan
27. dans le Minnesota / au Minnesota
28. dans le Mississippi / au Mississippi
29. dans le Missouri / au Missouri
30. dans le Montana / au Montana
31. dans le Nebraska / au Nebraska
32. dans le Nevada / au Nevada
33. dans le New Hampshire / au New Hampshire
34. dans le New Jersey / au New Jersey
35. dans l’État de New York / au New York
36. au Nouveau-Mexique
37. en Ohio
38. en Oklahoma
39. en Orégon
40. en Pennsylvanie
41. dans le Rhode Island
42. dans le Tennessee / au Tennessee
43. au Texas
44. en Utah
45. dans le Vermont / au Vermont
46. en Virginie
47. en Virginie-Occidentale
48. dans l’État de Washington
49. dans le Wisconsin / au Wisconsin
50. dans le Wyoming / au Wyoming

<https://www.frenchtoday.com/blog/french-grammar/french-prepositions-countries-cities-regions>