

ABSTRAK

PENGARUH *CURRENT RATIO* (CR), *DEBT TO EQUITY RATIO* (DER), *TOTAL ASSET TURNOVER* (TATO), *RETURN ON ASSETS* (ROA), DAN *EARNING PER SHARE* (EPS) TERHADAP *RETURN SAHAM* PADA PERUSAHAAN MANUFAKTUR SEKTOR INDUSTRI BARANG KONSUMSI YANG TERDAFTAR DI BEI

OLEH:

AYU SITI NAMIRA NASUTION
11471205535

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh *Current Ratio* (CR), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Total Asset Turnover* (TATO), *Return on Assets* (ROA), dan *Earning Per Share* (EPS) terhadap *Return Saham* pada perusahaan Manufaktur sektor Industri Barang Konsumsi yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI), baik secara persial maupun simultan. Sampel dalam penelitian ini diperoleh dengan menggunakan teknik *purposive sampling*, sehingga diperoleh 27 sampel dengan penelitian 2015-2017. Analisis data pengujian hipotesis menggunakan analisis regresi data panel dengan bantuan program *EViews 10*. Pemilihan model yang dipakai didalam analisis adalah Uji Chow dengan metode *Fixed Effect Model*. Berdasarkan hasil penelitian menunjukkan bahwa secara persial *Current Ratio* (CR) berpengaruh negatif signifikan terhadap *Return Saham* dengan tingkat signifikan sebesar $(0,00875 < 0,05)$. *Debt to Equity Ratio* (DER) berpengaruh negatif signifikan terhadap *Return Saham* dengan tingkat signifikan sebesar $(0,0006 < 0,05)$. *Total Asset Turnover* (TATO) berpengaruh negatif signifikan terhadap *Return Saham* dengan tingkat signifikan sebesar $(0,0074 < 0,05)$. *Return on Assets* (ROA) berpengaruh positif signifikan terhadap *Return Saham* dengan tingkat signifikan sebesar $(0,0000 < 0,05)$. *Earning Per Share* (EPS) tidak berpengaruh signifikan terhadap *Return Saham* dengan tingkat signifikan sebesar $(0,0875 > 0,05)$. Untuk hasil pengujian secara simultan diperoleh $F \text{ hitung} > F \text{ tabel} = 4,717456 > 2,30$ berarti hipotesis secara simultan antara pengaruh *Current Ratio* (CR), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Total Asset Turnover* (TATO), *Return on Assets* (ROA), dan *Earning Per Share* (EPS) secara bersama-sama berpengaruh signifikan terhadap *Return Saham*. Dari hasil penelitian ini juga diperoleh *Koefisien Determinasi* (R^2) dengan nilai) sebesar 0.658029 atau 65,80% dipengaruhi variabel independent dan sisanya sebesar 34,20% dipengaruhi oleh variabel lain yang tidak dijelaskan dalam penelitian ini.

Kata Kunci: *Current Ratio* (CR), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Total Asset Turnover* (TATO), *Return on Assets* (ROA), *Earning Per Share* (EPS), *Return Saham*