ABSTRAK

Latar belakang dilakukannya penelitian yang berjudul Analisis Faktor-Faktor Yang Mempengaruhi *Return* Saham, adalah karena adanya kondisi ekonomi yang tidak stabil yang menyebabkan fluktuasi kinerja keuangan beberapa perusahaan dan adanya inkonsisten beberapa penelitian terdahulu. Penelitian ini dilakukan untuk menganalisis pengaruh *Debt to Equity Ratio* (DER), *Current Ratio* (CR), *Price to Book Value* (PBV), *Total Assets Turnover* (TATO), dan *Return on Assets* (ROA) terhadap *Return* saham pada perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2007-2010.

Populasi dalam penelitian ini sejumlah 149 perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2007-2010 dan setelah melewati tahap *purposive sampling* jumlah sampel menjadi 60 perusahaan dengan data sampel berupa laporan keuangan, terdiri dari *Debt to Equity Ratio* (DER), *Current Ratio* (CR), *Price to Book Value* (PBV), *Total Assets Turnover* (TATO), dan *Return on Assets* (ROA) terhadap *Return* saham. Teknik analisis yang digunakan adalah regresi berganda dan uji hipotesis menggunakan t-statistik untuk menguji koefisien regresi parsial serta f-statistik untuk menguji keberartian pengaruh secara bersama-sama dengan *level of significance* 5%.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa *Current Ratio* (CR), dan *Return on Assets* (ROA) memberikan pengaruh yang negatif dan tidak signifikan, *Debt to Equity Ratio* (DER) memberikan pengaruh negatif dan signifikan, *Price to Book Value* (PBV) memberikan pengaruh yang positif dan signifikan, *Total Assets Turnover* (TATO) memberikan pengaruh yang positif dan tidak signifikan terhadap *Return* saham. Selaku penulis menyarankan kepada para investor di Bursa Efek Indonesia agar memberi perhatian lebih terhadap informasi yang dikeluarkan oleh perusahaan dalam membuat keputusan investasinya.

Kata Kunci : *Debt to Equity Ratio* (DER), *Current Ratio* (CR), *Price to Book Value* (PBV), *Total Assets Turnover* (TATO), *Return on Assets* (ROA), *Return* saham

FEB UNDIP