

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan mengetahui pengaruh kinerja keuangan yang terdiri dari rasio EPS, PER, DER, ROI, dan ROE secara parsial maupun serentak terhadap return saham perusahaan otomotif dan komponennya di Bursa Efek Indonesia serta untuk mengetahui rasio yang dominan mempengaruhi return saham perusahaan otomotif dan komponennya di Bursa Efek Indonesia. Pendekatan penelitian yang digunakan adalah pendekatan kuantitatif yang berfungsi untuk menguji hipotesis yang diajukan dalam penelitian serta untuk menjawab permasalahan dalam penelitian ini.

Sampel yang diambil sebanyak 5 perusahaan otomotif dan komponennya yang terdaftar di BEI serta memiliki saham aktif selama tahun 2004 – 2009. untuk mendapatkan informasi yang dibutuhkan dilakukan proses pengumpulan data melalui dokumentasi. Untuk metode pengumpulan data yang dilakukan dengan membuat salinan dengan cara mengumpulkan arsip dan catatan-catatan perusahaan yang ada. Alat analisis penelitian yang digunakan adalah analisis regresi linear berganda. Hasil analisis menunjukkan bahwa rasio keuangan yang terdiri dari rasio EPS, PER, DER, ROI, dan ROE berpengaruh secara serentak terhadap return saham perusahaan otomotif dan komponennya yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Rasio keuangan yang berpengaruh secara parsial terhadap return saham perusahaan otomotif dan komponennya yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia adalah rasio EPS dan ROI, sedangkan PER, DER dan ROE tidak berpengaruh terhadap return saham secara parsial.

Kata-kata Kunci : Rasio Keuangan, Return Saham, Perusahaan otomotif dan komponennya.