

ABSTRACT

This research was intended to identify the impact of Current Ratio (CR), Total Asset Turnover (TATO), Debt Equity Ratio (DER), Return On Equity (ROE), and Price Earning Ratio (PER) on stock return. Population in this research is a company sub-sector plastic and packaging listed in BEI 2011-2015 period. With the selection of samples used sampling purposive, obtained 7 company samples that meet the criteria. The research design is used causal research. The collection of data used library research. The method of analysis used are regression panel data.

The result showed that Current Ratio (CR) to a positive effect on stock return of the company sub-sector plastics and packaging listed in BEI 2011-2015 period. Total Asset Turnover (TATO) and Price Earning Ratio (PER) to a negative effect on stock return of the company sub-sector plastics and packaging listed in BEI 2011-2015 period. Debt Equity Ratio (DER) and Return On Equity (ROE) has no effect on stock return of the company sub-sector plastics and packaging listed in BEI 2011-2015.

Keyword: CR, TATO, DER, ROE PER, Stock Return



ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh *Current Ratio* (CR), *Total Asset Turnover* (TATO), *Debt Equity Ratio* (DER), *Return On Equity* (ROE) dan *Price Earning Ratio* (PER) terhadap *return* saham. Populasi yang digunakan dalam penelitian ini adalah perusahaan sub sektor plastik dan kemasan yang terdaftar di BEI periode 2011-2015. Dengan pemilihan sampel menggunakan purposive sampling, didapatkan 7 sampel perusahaan yang memenuhi kriteria. Desain penelitian yang digunakan adalah penelitian kausal. Teknik pengumpulan data menggunakan studi kepustakaan. Metode analisis yang digunakan adalah regresi data panel.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa *Current Ratio* (CR) berpengaruh positif terhadap *return* saham perusahaan sub sektor plastik dan kemasan yang terdaftar di BEI periode 2011-2015. *Total Asset Turnover* (TATO) dan *Price Earning Ratio* (PER) berpengaruh negatif terhadap *return* saham perusahaan sub sektor plastik dan kemasan yang terdaftar di BEI periode 2011-2015. *Debt Equity Ratio* (DER) dan *Return On Equity* (ROE) tidak berpengaruh terhadap *return* saham perusahaan sub sektor plastik dan kemasan yang terdaftar di BEI periode 2011-2015.

Kata Kunci: CR, TATO, DER, ROE, PER, *Return* Saham

