

ABSTRACT

Capital markets play an important role in the world economy, the role of the company's capital market is the availability of funds from investors to companies while on the side of investors are expected to return on the return of deposit funds. The purpose of the investors' investment rate of return is obtained as much as possible with a small degree of risk. By because the investors are expected to have the ability to predict future returns for his purpose of these investments. Stock analysis can be done by examining the financial ratios of the company. The purpose of this study is to determine the effect of the Return On Asset (ROA), the Current Ratio (CR), Debt To Equity Ratio (DER) and Earning Per Share (EPS) of the Stock Return.

This research was conducted during the period 2011-2014 with a sample of 9 companies Food and Beverage listed on the Stock Exchange. Data analysis method used is the Panel Data Analysis. Regression model testing conducted by a statistical test that is Model Testing T. Based on research conducted obtain the results that, based on t test results showed that the variables ROA, CR, DER and EPS significantly influence Stock Return.

Keywords: *Return on Assets (ROA), Current Ratio (CR), Debt To Equity Ratio (DER) and Earning Per Share (EPS) and Stock Return.*



ABSTRAK

Pasar modal memainkan peranan yang penting dalam dunia perekonomian, peran pasar modal dari sisi perusahaan adalah tersedianya dana dari investor ke perusahaan sedangkan dari sisi investor diharapkan akan dapat pengembalian return dari penyetoran dana tersebut. Tujuan dari para investor terhadap investasinya adalah memperoleh tingkat pengembalian yang sebesar-besarnya dengan tingkat resiko yang kecil. Oleh kerena itu para investor diharapkan mempunyai kemampuan untuk memprediksi return yang akan datang demi mencapai tujuannya dari investasi tersebut. Analisis saham dapat dilakukan dengan meneliti rasio-rasio keuangan yang dimiliki perusahaan. Tujuan penelitian ini yaitu untuk mengetahui pengaruh *Return On Asset* (ROA), *Current Ratio* (CR), *Debt To Equity Ratio* (DER) dan *Earning Per Share* (EPS) terhadap Return Saham.

Penelitian ini dilakukan selama periode 2011–2014 dengan sampel sebanyak 9 perusahaan *Food and Beverage* yang terdaftar di BEI. Metode analisis data yang digunakan adalah Analisis Data Panel. Pengujian model regresi dilakukan dengan uji statistik yaitu Pengujian Model T. Berdasarkan penelitian yang dilakukan memperoleh hasil yaitu, berdasarkan hasil uji t menunjukkan bahwa variabel ROA, CR, DER dan EPS berpengaruh signifikan terhadap Return Saham.

Kata kunci: *Return On Asset* (ROA), *Current Ratio* (CR), *Debt To Equity Ratio* (DER) dan *Earning Per Share* (EPS) dan *Return Saham*.

UNIVERSITAS
MERCU BUANA