

ABSTRACT

This research aims to determine the effect of Debt to Equity Ratio (DER), Current Ratio (CR), Return On Asset (ROA), Total Asset Turnover (TATO) towards stock Return. The object of this research is company research company Automotive and Parts Sub sector listed in Indonesia Stock Exchange 2011-2015 period. The research design is causal research. With the selection of the sample using purposive sampling. This research was conducted during the period 2011-2015 with a sample of seven companies Subsector Automotive and Components listed on the Stock Exchange. The data used in this study is a literature study, obtained from www.idx.co.id and secondary data. Data analysis method used is the Panel Data Analysis.

The result of this research shows that Current Ratio (CR) has negative and Return On Asset (ROA) Return positive effect on the stock in Sub Sectors Automotive and Components period 2011-2015. Debt to Equity Ratio (DER) and Total Asset Turnover (TATO) has no effect on the stock Return Sub-Sector Automotive and Components period 2011-2015.

Keywords: DER, CR, ROA, TATO, Stock Return.



ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh *Debt to Equity Ratio* (DER), *Current Ratio* (CR), *Return On Asset* (ROA), *Total Asset Turnover* (TATO) terhadap *Return Saham*. Objek penelitian ini adalah perusahaan Sub Sektor Otomotif dan Komponen yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2011-2015. Desain penelitian yang digunakan adalah penelitian kausal. Dengan pemilihan sampel menggunakan *purposive sampling*. Penelitian ini dilakukan selama periode 2011-2015 dengan sampel sebanyak 7 perusahaan Sub Sektor Otomotif dan Komponen yang terdaftar di BEI. Data yang digunakan dalam penelitian ini adalah studi kepustakaan, yang diperoleh dari www.idx.co.id dan data sekunder. Metode analisis data yang digunakan adalah Analisis Data Panel.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa *Current Ratio* (CR) berpengaruh negatif dan *Return On Asset* (ROA) berpengaruh positif terhadap *Return* saham pada Sub Sektor Otomotif dan Komponen periode 2011-2015. *Debt to Equity Ratio* (DER) dan *Total Asset Turnover* (TATO) tidak berpengaruh terhadap *Return* saham pada Sub Sektor Otomotif dan Komponen periode 2011-2015.

Kata Kunci : DER, CR, ROA, TATO, *Return Saham*.

