

ABSTRACT

This study aimed to examine the effect of the financial performance of stock returns on companies listed in the Indeks Kompas 100 Period 2011 - 2015. Methods of hypothesis testing using the t test, and multiple linear regression. This research use Current Ratio, Debt To Equity Ratio, Return On Equity as independent variable and Stock Return as dependent variable. The Samples taken as many as 13 companies listed in the Indeks Kompas 100 during 2011 to 2015. The data used are the financial statements of each sample company published through the website [ww.idx.co.id](http://www.idx.co.id). data analysis methods used in this research is quantitative method to test statistical analysis multiple linear regression analysis. The sampling method used is purposive sampling. The result of this research is the Return on Assets (ROE), Debt to Equity Ratio (DER), the Current Ratio (CR) effect on stock returns. Partially Return on Equity (ROE) berpengaruh to stock return. While Debt to Equity Ratio (DER) and the Current Ratio (CR) has no effect on stock returns.

Key Words : *Return on Equity, Debt to Equity Ratio, Current Ratio and Stock Return.*



ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menguji pengaruh kinerja keuangan terhadap *return* saham pada perusahaan yang terdaftar di Indeks Kompas 100 Periode 2011 – 2015. Metode pengujian hipotesis menggunakan uji t, dan regresi linear berganda. Variabel yang digunakan dalam penelitian ini adalah *Current Ratio* (X1), *Debt To Equity Ratio* (X2), *Return On Equity* (X3) sebagai variabel independen dan *return* saham sebagai variabel dependen. Sampel yang diambil sebanyak 13 perusahaan yang terdaftar di Indeks Kompas 100 Indonesia (BEI) selama tahun 2011 sampai 2015. Data yang digunakan adalah laporan keuangan dari masing-masing perusahaan sampel yang dipublikasikan melalui website [ww.idx.co.id](http://www.idx.co.id). metode analisis data yang digunakan dalam penelitian ini adalah metode kuantitatif dengan pengujian analisis statistik yaitu analisis regresi linear berganda. Metode pengambilan sampel yang digunakan adalah *purposive sampling*. Hasil penelitian ini adalah *Return on Asset* (ROE), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Current Ratio* (CR) berpengaruh terhadap *return* saham. Secara parsial *Return on Equity* (ROE) berpengaruh terhadap *return* saham. Sedangkan *Debt to Equity Ratio* (DER) dan *Current Ratio* (CR) tidak berpengaruh terhadap *return* saham.

Kata Kunci : *Return on Equity*, *Debt to Equity Ratio*, *Current Ratio* dan *Return Saham*



UNIVERSITAS
MERCU BUANA