

ABSTRACT

Unzilailaikah Alvi Husna, 130211100029. Analysis the Influence Of Debt to Equity Ratio (DER), Return on Assets (ROA), and Current Ratio (CR) Toward Stock Return on the Non-Bank LQ 45 Companies Listed on the Indonesia Stock Exchange (BEI) at 2012-2016 Periods. Under The Guidness Mr. Drs. Ec. Makhmud Zulkifli, Msi and Mr. Drs. Ec. Bambang Sudarsono, MM.

The purpose of this research is to analyze the influence of Debt to Equity Ratio (DER), Return on Assets (ROA) and Current Ratio (CR) Toward Stock Return. This research is taken because there is still differences of research between one research with another and there is a difference between real condition from research data with existing theory.

This research is usequantitative method non-Bank on the LQ 45 companies that listed on the BEI at 2012-2016 periods. The sample technique use is purposive sampling. From twenty two companies, only seventeen companies were taken. The analysis method use is multiple linear regression analysis.

By using regression analysis, it can be seen that Debt to Equity Ratio, Return on Assets and Current Ratio has negative and insignificant effect on stock returns. Other than that obtained that the value of R square is 8,4%, it is explained that the variation of the dependent variable of 8,4% while the remaining 91,6% is influenced by other variables not describe in this research.

Keywords : *Stock Return, Debt to Equity Ratio, Return on Assets and Current Ratio*

ABSTRAK

Unzilailaika Alvi Husna, 130211100029. Analisis Pengaruh *Debt to Equity Ratio*, *Return on Assets* dan *Current Ratio* terhadap *Return Saham* pada Perusahaan Non-Bank LQ 45 yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) Periode 2012 – 2016. Dibawah bimbingan Drs. Ec. Makhmud Zulkifli, Msi and Drs. Ec. Bambang Sudarsono, MM.

Tujuan penelitian ini adalah untuk menganalisis pengaruh *Debt to Equity Ratio (DER)*, *Return on Assets (ROA)* dan *Current Ratio (CR)* terhadap *Return Saham*. Penelitian ini diambil karena masih terdapat perbedaan penelitian antara penelitian yang satu dengan yang lain serta terdapat perbedaan antara keadaan riilnya dari data penelitian dengan teori yang ada.

Penelitian ini dilakukan dengan metode kuantitatif terhadap perusahaan non-Bank LQ 45 yang terdaftar di BEI periode 2012-2016. Teknik sampel yang digunakan adalah *purposive sampling*. Dari dua puluh dua perusahaan, hanya diambil tujuh belas perusahaan. Metode analisis yang digunakan adalah analisis regresi linier berganda.

Dengan menggunakan analisa regresi, maka dapat diketahui bahwa *Debt to Equity Ratio*, *Return on Assets* dan *Current Ratio* berpengaruh negatif dan tidak signifikan terhadap *return saham*. Selain itu diperoleh bahwa nilai *R square* adalah 8,4%, hal ini menjelaskan bahwa variasi variabel dependen sebesar 8,4% sedangkan sisanya 91,6% dipengaruhi oleh variabel lain yang tidak dijelaskan dalam penelitian ini.

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