

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh kinerja keuangan terhadap *return* saham pada perusahaan yang *go public* di BEI tahun 2012. Variabel dependennya adalah *return* saham sedangkan variabel independennya adalah CR, DER, EPS, ROA, dan ROI. Sampel penelitian yang digunakan sebanyak 218 perusahaan. Penelitian ini menggunakan pendekatan kuantitatif dengan melakukan pengujian hipotesis menggunakan uji analisis regresi linier berganda.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa variabel CR, DER, EPS, ROA, dan ROI secara simultan tidak berpengaruh terhadap *return* saham. Secara parsial menunjukkan bahwa variabel CR, DER, EPS, ROA, dan ROI tidak berpengaruh terhadap *return* saham. Sehingga dalam penelitian ini rasio-rasio keuangan tidak bisa digunakan untuk memrediksi *return* saham.

Kata kunci: *Current Ratio (CR), Debt to Equity Ratio (DER), Earning Per Share (EPS), Return on Assets (ROA), Return on Investment (ROI), Return saham*

ABSTRACT

The purpose of this research is to know the effect of financial performance toward the company stock return that already go public in the Indonesia Stock Exchange in 2012. Dependent variable is stock return and the independent variable are CR, DER, EPS, ROA, and ROI. The samples of this research 218 companies. The research used quantitative approach with hypothesis test using multiple linear regression analysis.

The results of this research show variable CR, DER, EPS, ROA, and ROI simultaneously don't have significant effect towards stock return. Partially, variable CR, DER, EPS, ROA, and ROI don't have significant effect towards stock return. So, in this research the financial ratios (CR, DER, EPS, ROA, and ROI) cannot be used to predict the stock return.

Keywords: *Current Ratio (CR), Debt to Equity Ratio (DER), Earning Per Share (EPS), Return on Assets (ROA), Return on Investment (ROI), Stock Return*