

## ABSTRAK

*Return* merupakan hasil yang diperoleh dari investasi. *Return* dibagi menjadi *Return Realisasi* dan *Return Ekspektasi*. ROA adalah rasio antara pendapatan bersih sesudah pajak terhadap total aset. DER mencerminkan kemampuan perusahaan dalam memenuhi kewajibannya yang ditunjukkan oleh beberapa bagian dari modal sendiri atau ekuitas yang digunakan untuk membayar hutang. CR merupakan salah satu ukuran likuiditas bertujuan untuk mengukur kemampuan perusahaan untuk melunasi kewajiban jangka pendeknya dengan aktiva lancar yang dimilikinya. *Earnings Per Share* (EPS) merupakan laba bersih per lembar saham yang dibagikan kepada investor atas hasil dari suatu investasi mereka. Nilai tukar merupakan perbandingan nilai atau harga dua mata uang. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui: 1. Pengaruh *Return On Assets* (ROA) terhadap *Return Saham* Perusahaan Sektor Barang Konsumsi yang terdaftar di BEI periode 2015-2017. 2. Pengaruh *Debt to Equity Ratio* (DER) terhadap *Return* saham Perusahaan Sektor Barang Konsumsi yang terdaftar di BEI periode 2015-2017. 3. Pengaruh *Current Ratio* (CR) terhadap *Return* saham Perusahaan Sektor Barang Konsumsi yang terdaftar di BEI periode 2015-2017. 4. Pengaruh *Earning Per Share* (EPS) terhadap *Return* saham Perusahaan Sektor Barang Konsumsi yang terdaftar di BEI periode 2015-2017. 5. Pengaruh Nilai Tukar terhadap *Return* saham Perusahaan Sektor Barang Konsumsi yang terdaftar di BEI periode 2015-2017. 6. Pengaruh ROA, DER, CR, EPS, Nilai Tukar terhadap *Return* saham Perusahaan Sektor Barang Konsumsi yang terdaftar di BEI periode 2015-2017. Populasi penelitian ini adalah Perusahaan Manufaktur Sektor Barang Konsumsi yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia pada tahun 2015-2017 sebanyak 43 perusahaan. Sampel penelitian sebanyak 19 perusahaan selama 3 tahun sehingga jumlah data yang diteliti 57 data sebelum outlier. Teknik pengumpulan data yang digunakan adalah studi pustaka dan dokumentasi. Teknik analisis data yang digunakan statistik deskriptif, uji asumsi klasik dan analisis regresi linier berganda. Hasil penelitian menunjukkan: ROA tidak berpengaruh terhadap *Return Saham*. Hal ini ditunjukkan dengan signifikansi 0,280 atau lebih dari 0,05. DER tidak berpengaruh terhadap *Return Saham*. Hal ini ditunjukkan dengan signifikansi 0,094 atau lebih dari 0,05. CR tidak berpengaruh terhadap *Return Saham*. Hal ini ditunjukkan dengan signifikansi 0,231 atau lebih dari 0,05. EPS tidak berpengaruh terhadap *Return Saham*. Hal ini ditunjukkan dengan signifikansi 0,257 atau lebih dari 0,05. Nilai Tukar berpengaruh terhadap *Return Saham*. Hal ini ditunjukkan dengan signifikansi 0,035 atau kurang dari 0,05. ROA, DER, CR, EPS dan Nilai Tukar tidak berpengaruh terhadap *Return Saham*. Hal ini ditunjukkan dengan signifikansi 0,086 atau lebih dari 0,05.

Kata kunci: *Return Saham*, *Return On Assets* (ROA), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Current Ratio* (CR), *Earning Per Share* (EPS), Nilai Tukar

## **ABSTRACT**

*Return is the result obtained from investment. Return is divided into Realization Return and Expectation Return. ROA is the ratio between net income after tax on total assets. DER reflects the company's ability to fulfill its obligations as indicated by several parts of its own capital or equity used to pay off debt. CR is one measure of liquidity that aims to measure a company's ability to pay off its short-term liabilities with its current assets. Earnings Per Share (EPS) is the net income per share that is shared with investors on the results of an investment. The exchange rate is a comparison of the value or price of two currencies. This study aims to find out: 1. Effect of Return On Assets (ROA) on Returns of Stocks of Consumer Goods Sector Companies listed on the Stock Exchange for the period 2015-2017. 2. Effect of Debt to Equity Ratio (DER) on Returns of shares of Consumer Goods Sector Companies listed on the IDX for the period 2015-2017. 3. Effect of Current Ratio (CR) on Returns of Stocks of Consumer Goods Sector Companies listed on the Stock Exchange for the period 2015-2017. 4. Effect of Earning Per Share (EPS) on Returns of shares of Consumer Goods Sector Companies listed on the Stock Exchange for the period 2015-2017. 5. Effect of Exchange Rates on Returns of shares of the Consumer Goods Sector Companies listed on the Stock Exchange for the period 2015-2017. 6. Effect of ROA, DER, CR, EPS, and Exchange Rate on Returns of shares of the Consumer Goods Sector Companies listed on the Stock Exchange for the period 2015-2017. The population of this study is the Manufacturing Company of the Consumer Goods Sector listed on the Indonesia Stock Exchange in 2015-2017 as many as 43 companies. The research sample was 19 companies for 3 years so the amount of data studied 57 data before the outlier. Data collection techniques used are library studies and documentation. Data analysis techniques used descriptive statistics, classic assumption tests and multiple linear regression analysis. The results showed: ROA did not affect Stock Return. This is indicated by the significance of 0.280 or more than 0.05. DER does not affect Stock Return. This is indicated by the significance of 0.094 or more than 0.05. CR does not affect Stock Return. This is indicated by the significance of 0.231 or more than 0.05. EPS does not affect Stock Return. This is indicated by the significance of 0.257 or more than 0.05. Exchange Rates affect Stock Return. This is indicated by the significance of 0.035 or less than 0.05. ROA, DER, CR, EPS and Exchange Rate do not affect Stock Return. This is indicated by the significance of 0.086 or more than 0.05.*

*Keywords: Stock Return, Return On Assets (ROA), Debt to Equity Ratio (DER), Current Ratio (CR), Earning Per Share (EPS), Exchange Rate*