

ABSTRAK

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk menguji seberapa besar pengaruh *Return on Asset (ROA)*, *Debt to Equity ratio (DER)* dan Ukuran Perusahaan (*SIZE*) terhadap *Return Saham*. Pemilihan variabel digunakan dalam penelitian ini karena hasil penelitian masih menunjukkan hasil yang tidak konsisten.

Populasi dalam penelitian ini adalah perusahaan *food & beverages* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2011 – 2015. Pemilihan sampel ditetapkan dengan menggunakan *purposive sampling* dengan total sampel penelitian yang berjumlah 11 perusahaan *food & beverages*. Data dikumpulkan dengan menggunakan metode observasi data sekunder. Analisis menggunakan analisis regresi linier berganda.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa ROA, DER, dan SIZE secara simultan berpengaruh signifikan terhadap return saham. Secara parsial ROA memberikan pengaruh signifikan terhadap *return* saham. Sedangkan DER dan SIZE tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham dikarenakan faktor-faktor lain yang mempengaruhi *return* saham.

Kata Kunci : Return on Asset (ROA), Debt to Equity ratio (DER), Ukuran Perusahaan (SIZE), dan Return Saham.

ABSTRACT

The purpose of this research is to examine how much the effect of the Return on Assets (ROA), Debt to Equity ratio (DER) and Company size (SIZE) to Stock Return. The selection of the variables use on this study because various studie showerd inconsistent results.

The population in this study were food & beverages company listed in Indonesia Stock Exchange period 2011 - 2015. The sample set by using purposive sampling with total sample 11 companies food and beverages. Data was collected through observation method of secondary data. Analysis using multiple linear regression analysis methode.

These results indicate that ROA, DER, and SIZE simultaneously significant effect on stock returns. Partially ROA significant impact on stock returns. DER and SIZE whereas no significant effect on stock returns because many other that affect stock returns.

Keywords: *Return on Assets (ROA), Debt to Equity ratio (DER), firm size (SIZE), and Stock Return.*