ABSTRAK

Cynthia Wijaya / 25150050 / 2019 / Pengaruh *Current Ratio* (CR), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Return On Asset* (ROA), dan *Price Earning Ratio* (PER) Terhadap *Return* Saham Pada Perusahaan Sektor Industri Barang Konsumsi yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2014-2017/ Pembimbing :Martha Ayerza Esra, S.E., M.M.

Penelitian ini memiliki tujuan untuk menganalisis seberapa besar pengaruh *Current Ratio*, *Debt to Equity Ratio*, *Return On Asset* dan *Price Earning Ratio* terhadap *return* saham pada perusahaan sektor industri barang konsumsi. Alasan memilih sektor industri barang konsumsi karena merupakan sektor yang tidak terpengaruh secara signifikan terhadap dampak krisis global.

Faktor-faktor yang diuji dalam penelitian adalah likuiditas dengan CR, solvabilitas dengan DER, profitabilitas dengan ROA, dan nilai pasar dengan PER sebagai variabel independen serta *return* saham sebagai variabel dependen.

Sampel dalam penelitian ini terdiri dari 19 perusahaan yang merupakan perusahaan sektor industri barang konsumsi yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) pada tahun 2014-2017. Data dalam penelitian ini menggunakan data sekunder dan pemilihan sampel menggunakan metode *judgement sampling*. Pengujian data penelitian digunakan dengan menggunakan analisis regresi berganda dengan bantuan program IBM SPSS versi 25.

Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwa : *Current Ratio* tidak berpengaruh terhadap *return* saham. *Debt to Equity Ratio* tidak berpengaruh terhadap *return* saham.. *Return On Asset* tidak berpengaruh terhadap *return* saham. *Price Earning Ratio* berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham

Peneliti selanjutnya disarankan untuk menggunakan variabel yang lebih banyak dalam penelitian ini untuk mendapatkan hasil yang lebih baik dikarenakan hasil penelitian memiliki tingkat R2 yang lemah.

Kata kunci : *current ratio*, *debt to equity ratio, return on asset, price earning ratio, return* saham