

ABSTRAK

Penelitian tentang pengaruh rasio-rasio keuangan sudah banyak dilakukan. Namun terdapat fenomena gap dari data-data perusahaan-perusahaan pada sektor *consumer goods* dimana terjadi fluktuasi atau ketidakstabilan. *Consumer goods* sendiri merupakan sektor yang cukup stabil karena produk yang dihasilkan merupakan kebutuhan sehari-hari. Tujuan dari penelitian ini yaitu untuk menganalisis pengaruh rasio likuiditas, *leverage*, profitabilitas, aktivitas dan penilaian pasar terhadap *return* saham perusahaan *consumer goods* pada tahun 2012 sampai dengan 2016.

Objek dalam penelitian ini yaitu perusahaan *consumer goods* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia dan memiliki laporan keuangan yang lengkap. Data penelitian bersumber dari ICMD periode 2012 – 2016. Perusahaan yang dipilih merupakan perusahaan yang sudah melakukan *Initial Public Offering* (IPO) pada jangka waktu penelitian. Perusahaan *consumer goods* sepanjang periode tersebut berjumlah 40 perusahaan dengan sampel penelitian sebesar 30 perusahaan.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa rasio likuiditas yang diukur dengan *current ratio*, rasio *leverage* diukur dengan *debt to equity ratio* dan rasio profitabilitas yang diukur menggunakan *return on equity* memiliki pengaruh yang negatif tapi tidak signifikan terhadap *return* saham. Sedangkan rasio aktivitas yang diukur dengan *total asset turnover* dan rasio pasar yang diukur dengan *price to book value* memiliki pengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham.

Kata kunci : *current ratio*, *debt to equity ratio*, *earning per share*, *total asset turnover*, *price to book value* dan *return* saham.