

## ABSTRAKSI

Penelitian ini dilakukan untuk menguji pengaruh kinerja keuangan terhadap Return saham yang dilakukan oleh perusahaan otomotif dan komponen yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2005 – 2011. variabel independen dalam penelitian ini adalah *Current Ratio*, *Debt to Equity Ratio*, *Total Asset Turn Over*, dan *Return On Asset*. Sedangkan Variabel dependen dalam penelitian ini adalah Return Saham.

Sampel dalam penelitian ini terdiri dari 17 perusahaan otomotif dan komponen yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia dari periode 2005 – 2011. Teknik sampling yang digunakan adalah purposive sampling dengan kriteria meliputi: perusahaan otomotif yang terdaftar di BEI periode 2005 – 2011, menyediakan data laporan keuangan dari tahun 2005 – 2011, dan perusahaan mempunyai data laporan keuangan lengkap 2005 – 2011. Data diperoleh dari publikasi ICMD 2011 dan situs resmi BEI ([www.idx.co.id](http://www.idx.co.id)). Teknik analisis yang digunakan adalah analisis regresi berganda. Pengujian hipotesis dilakukan dengan uji simultan F dan Uji parsial t, dengan tingkat signifikansi sebesar 5%

Hasil penelitian dengan analisis regresi berganda menunjukkan bahwa pengaruh secara simultan *Current Ratio*, *Debt to Equity Ratio*, *Total Asset Turn Over*, dan *Return On Asset* terhadap Return Saham mempunyai pengaruh yang signifikan. Pengaruh secara parsial menunjukkan bahwa *Current Ratio* tidak berpengaruh terhadap Return Saham, *Debt to Equity Ratio* tidak berpengaruh terhadap Return Saham, *Total Asset Turn Over* tidak berpengaruh terhadap Return Saham, sedangkan *Return On Asset* berpengaruh signifikan terhadap Return Saham.

**Kata Kunci:** *Return Saham, Current Ratio, Debt to Equity Ratio, Total Asset Turn Over, Return On Asset.*