

ABSTRAK

Return saham adalah keuntungan yang diperoleh dari investasi sebuah saham, tentu pada dasarnya investor menginginkan jaminan akan *Return* yang tinggi pada saham yang ingin di investasikan. Tingkat rata-rata *Return* saham pada perusahaan sub sektor transportasi mengalami pergerakan naik turun pada perusahaan sub sektor transportasi selama tahun 2013-2018. Karena terjadinya pergerakan *Return* saham yang naik turun membuat investor akan melakukan pertimbangan terhadap kinerja keuangan perusahaan sebelum melakukan investasi. Oleh sebab itu, investor sangat perlu mengetahui dan melakukan analisis terhadap faktor-faktor apa saja yang dapat mempengaruhi tingkat *Return* saham.

Penelitian ini bertujuan untuk menguji pengaruh *Current Ratio* (CR), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Earning per Share* (EPS) dan *Return on Asset* (ROA) terhadap *Return Saham* pada perusahaan sub sektor transportasi yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia tahun 2013-2018. Data yang digunakan dalam penelitian ini diperoleh dari laporan keuangan tahunan (laporan keuangan konsolidasi) periode 2013-2018.

Populasi dalam penelitian ini adalah perusahaan sub sektor transportasi yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Teknik pemilihan sampel yang digunakan adalah *purposive sampling* dengan periode penelitian tahun 2013-2018. Metode analisis data dalam penelitian ini adalah analisis regresi data panel dengan menggunakan *software Eviews 9.0*.

Berdasarkan hasil penelitian, secara simultan CR, DER, EPS dan ROA berpengaruh terhadap *Return Saham*. Sedangkan secara parsial CR, DER dan ROA tidak berpengaruh signifikan terhadap *Return Saham* dan hanya variabel EPS berpengaruh positif signifikan terhadap *Return Saham*.

Kata kunci: *Current Ratio* (CR), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Earning per Share* (EPS), *Return on Asset* (ROA), *Return Saham*.