

ABSTRAK

PENGARUH NILAI TUKAR RUPIAH, *CURRENT RATIO*, *FINANCIAL LEVERAGE* DAN *RETURN ON ASSET* TERHADAP RETURN SAHAM PADA SEKTOR ANEKA INDUSTRI YANG TERCATAT DI BURSA EFEK INDONESIA PERIODE TAHUN 2014-2018

DAVID KLISMEN

Email : davidklismen@gmail.com

DELLIN

Email : dellinewen9808@gmail.com

PHELLEN TANNEA

Email : phellenchen@gmail.com

GRESELLA

Email : gresella.gui@gmail.com, gresella.guii@gmail.com

Mas Intan Purba, S.Si, M.Si.

Email : masintanpurba84@gmail.com

**Program Studi S1 - Akuntansi
Fakultas Ekonomi Universitas Prima Indonesia**

Tujuan yaitu untuk menguji dan menganalisis bagaimana pengaruh Nilai Tukar Rupiah, *Current Ratio*, *Financial Leverage* dan *Return On Asset* terhadap Return Saham pada sektor aneka industri yang tercatat di Bursa Efek Indonesia. Metode penelitian menggunakan pendekatan kuantitatif. Populasi berjumlah 42 perusahaan dan sampel didapat 9 perusahaan dengan teknik *purposive sampling*. Teknik analisis adalah metode regresi linear berganda. Hasil penelitian menunjukkan bahwa *Current Ratio* berpengaruh signifikan terhadap *Return Saham*. Sedangkan Nilai Tukar Rupiah, *Financial Leverage* dan *Return On Asset* tidak berpengaruh dan tidak signifikan terhadap *Return Saham*. Dan secara simultan Nilai Tukar Rupiah, *Current Ratio*, *Financial Leverage* dan *Return On Asset* berpengaruh signifikan terhadap *Return Saham*. Besarnya koefisien determinasi sebesar 44,2% sedangkan sisanya sebesar 55,8% *Return Saham* dijelaskan oleh variabel lain yang tidak dalam penelitian ini. Kesimpulan adalah secara parsial hanya *Current Ratio* berpengaruh signifikan terhadap *Return Saham* pada sektor aneka industri yang tercatat di Bursa Efek Indonesia periode tahun 2014-2018.

Kata Kunci : Nilai Tukar Rupiah, *Current Ratio*, *Financial Leverage*, *Return On Asset*, *Return Saham*