

ABSTRAK

Lesi Teni Puzisara (1138020130): *Pengaruh Return on Assset (ROA) dan Current Ratio (CR) Terhadap Return Saham pada Perusahaan Sektor Telekomunikasi Periode Tahun 2006-2016.*

Penelitian ini dilatarbelakangi oleh kemajuan alat komunikasi baik dalam lingkup masyarakat maupun dunia bisnis. Hal ini membuat perusaha-perusahaan jasa dibidang telekomunikasi berlomba dalam mendapatkan ekspansi modal dari para investor guna kemajuan perusahaannya. Salah satu perangkat yang amat strategis dalam menopang citra tersebut adalah *Return Saham* perusahaan yang baik. *Return Saham* yang nanti akan didapatkan oleh investor dapat berupa dividen perusahaan dari hasil penjualan dan produksi maupun *Return Saham* yang diperoleh dari naiknya harga saham perusahaan tersebut.

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh dari *Return on Assset* (ROA) dan *Current Ratio* (CR) terhadap *Return Saham* pada Perusahaan Sektor Telekomunikasi yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Periode yang digunakan dalam penelitian ini adalah selama 11 tahun, mulai dari tahun 2006 sampai dengan tahun 2016.

Teknik pemilihan sampel menggunakan metode *purposive sampling*, dan diperoleh 33 data keuangan per tahun perusahaan yang digunakan sebagai sampel. Teknik analisis data yang digunakan adalah analisis regresi linear beganda dan regresi data panel untuk menentukan pemilihan model *fixed effect model* atau *random effect model*.

Berdasarkan hasil analisis data, secara parsial *Return On Assset* (ROA) berpengaruh positif dan signifikan terhadap *Return Saham* diketahui dari koefisien regresi sebesar 0.041663 dengan t_{hitung} sebesar 2.373163 dan tingkat signifikansi sebesar 0.0242 ($0.0242 \leq 0.05$) $t_{hitung} \geq t_{tabel}$ ($2.373163 \geq 1.69726$). Pada Variabel selanjutnya yaitu *Curret Ratio* (CR) juga berpengaruh positif dan signifikan terhadap *Return Saham* diketahui dari koefisien regresi sebesar 0.050635 dengan t_{hitung} sebesar 2.668744 dan tingkat signifikansi sebesar 0.0122 ($0.0122 \leq 0.05$) $t_{hitung} \geq t_{tabel}$ ($2.668744 \geq 1.69726$). Berdasarkan uji hipotesis, diketahui nilai F statistik sebesar 30.99166 dengan signifikansi sebesar 0.000001 $F_{hitung} \geq F_{tabel}$ ($30.99166 \geq 3.32$). Nilai *R-Square* sebesar 0.673854, hal ini berarti kemampuan kedua variabel independen yaitu *Return on Assset* (ROA) dan *Current Ratio* (CR) dalam menjelaskan variasi variabel dependen *Return Saham* adalah sebesar 67%, sedangkan sisanya dijelaskan oleh variabel lain di luar model penelitian.

Kata Kunci: *Return On Assset (ROA), Current Ratio (CR) dan Return Saham*