

INTISARI

Tujuan penelitian ini adalah untuk melakukan analisis terhadap pengaruh pengukuran kinerja keuangan dengan menggunakan rasio keuangan yaitu rasio profitabilitas, likuiditas, aktivitas, *leverage* dan rasio *Market Value* (nilai pasar) untuk memprediksi *return* saham pada perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia.

Populasi yang digunakan dalam penelitian ini adalah perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia selama tahun 2009 sampai dengan 2012. Pengambilan sampel perusahaan dalam penelitian ini dilakukan dengan metode *purposive sampling* yaitu dengan didasarkan pada perusahaan manufaktur yang menerbitkan laporan keuangan resmi dan informasi harga saham selama periode pengamatan. Data tersebut diperoleh dari *Indonesia Stock Exchange* (IDX), *Yahoo Finance*, dan situs resmi perusahaan. Jumlah sampel yang digunakan dalam penelitian ini sebanyak 95 perusahaan dan hipotesis diuji menggunakan analisis regresi berganda dengan bantuan pengolahan data SPSS 15,0.

Hasil penelitian ini memberikan kesimpulan bahwa variabel rasio keuangan secara bersama-sama memiliki pengaruh yang signifikan terhadap *return* saham. Hasil pengujian secara partial pada variabel rasio ROA, ROE, NPM, *Current Ratio*, TAT, DER, DAR, MBV diperoleh bahwa hanya variabel ROA dan ROE saja yang memiliki pengaruh positif signifikan terhadap *return* saham.

Kata Kunci: Rasio Profitabilitas, Likuiditas, Aktivitas, *Leverage*, Rasio *Market Value*, dan *Return* saham