

ABSTRAKSI

Khalila Fairas Arasy, Nomor Mahasiswa 152120004, Program Studi Administrasi Bisnis, Fakultas Ilmu Sosial dan Ilmu Politik, Universitas Pembangunan Nasional “Veteran” Yogyakarta. Judul Pengaruh *Return On Equity* (ROE), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Total Asset Turnover* (TATO), *Earning Per Share* (EPS), dan *Price Earning Ratio* (PER) terhadap Harga Saham pada Perusahaan Makanan dan Minuman yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) tahun 2010 – 2014, 2016. Dosen pembimbing I Suratna M.AB. Dosen pembimbing II Dr. Sigit Haryono, S.Sos., M.Si.

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui adakah pengaruh *Return On Equity* (ROE), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Total Asset Turnover* (TATO), *Earning Per Share* (EPS), dan *Price Earning Ratio* (PER) secara simultan terhadap harga saham pada perusahaan makanan dan minuman yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia tahun 2010 – 2014. adakah pengaruh *Return On Equity* (ROE), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Total Asset Turnover* (TATO), *Earning Per Share* (EPS), dan *Price Earning Ratio* (PER) secara parsial terhadap harga saham pada perusahaan makanan dan minuman yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia tahun 2010 – 2014.

Variabel bebas (*independent*) dari penelitian ini adalah *Return On Equity* (ROE), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Total Asset Turnover* (TATO), *Earning Per Share* (EPS), dan *Price Earning Ratio* (PER), dan variabel terikat (*dependent*) dari penelitian ini adalah harga saham. Metode penelitian yang digunakan adalah eksplanatif dan alat analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah menggunakan regresi linear berganda dengan mempertimbangkan uji normalitas dan uji asumsi klasik. Sampel yang digunakan adalah sepuluh perusahaan Makanan dan Minuman yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) tahun 2010 – 2014.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa model regresi yang diajukan telah memenuhi syarat berdistribusi normal dan tidak melanggar asumsi klasik (multikolinearitas, autokorelasi, dan heteroskedastisitas). Berdasarkan hasil analisis didapatkan bahwa secara simultan variabel *Return On Equity* (ROE), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Total Asset Turnover* (TATO), *Earning Per Share* (EPS), dan *Price Earning Ratio* (PER) berpengaruh signifikan terhadap Harga Saham. Secara parsial variabel *Return On Equity* (ROE), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Earning Per Share* (EPS), dan *Price Earning Ratio* (PER) berpengaruh tidak signifikan terhadap Harga Saham, sedangkan variabel *Total Asset Turnover* (TATO) secara parsial berpengaruh signifikan terhadap Harga Saham.

Saran berdasarkan penelitian ini adalah dengan berpengaruhnya *Total Asset Turnover* (TATO) terhadap harga saham dapat dijadikan pertimbangan bagi perusahaan maupun investor untuk memprediksi harga saham dan meningkatkan kinerja keuangan, dan perusahaan perlu memperhatikan dalam pengambilan keputusan yang kaitannya dengan pengembangan perusahaan serta bagi investor sebagai penanam modal perlu memperhatikan keuntungan yang akan diperoleh dari saham.

Kata Kunci : *Return On Equity (ROE), Debt to Equity Ratio (DER), Total Asset Turnover (TATO), Earning Per Share (EPS), Price Earning Ratio (PER), Harga Saham*