

## ABSTRAK

Tujuan penelitian ini adalah mencari bukti empiris mengenai pengaruh rasio likuiditas, profitabilitas, *leverage*, dan aktivitas terhadap *return* saham pada perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Penelitian ini menggunakan sampel perusahaan manufaktur dengan periode penelitian tahun 2009 sampai dengan 2011. Sampel dalam penelitian ini diperoleh dengan menggunakan metode *purposive sampling*. Berdasarkan kriteria yang ada maka diperoleh 93 perusahaan yang menjadi sampel penelitian.

Hasil uji secara simultan (Uji-F) menunjukkan bahwa semua variabel independen (rasio likuiditas, profitabilitas, *leverage*, dan aktivitas) berpengaruh signifikan terhadap *return* saham. Hasil uji secara parsial (Uji-t) menunjukkan bahwa rasio likuiditas tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham, rasio profitabilitas tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham, rasio *leverage* tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham dan rasio aktivitas berpengaruh signifikan terhadap *return* saham.

Kata kunci: *Return* Saham, Rasio Likuiditas, Profitabilitas, *Leverage*, dan Aktivitas.