

ABSTRAK

Tujuan dari penelitian ini adalah mengetahui pengaruh rasio likuiditas, rasio *leverage*, rasio aktivitas, rasio profitabilitas dan *firm size* terhadap *return* saham. Penelitian ini merupakan penelitian kausal. Populasi dalam penelitian ini adalah perusahaan yang termasuk dalam industri makanan dan minuman yang terdaftar di BEI yang mencatatkan sahamnya pada periode 1 Januari 2005 sampai 31 Desember 2010. Teknik pengambilan sampel menggunakan metode *purposive sampling*, sehingga diperoleh sampel sebanyak 12 perusahaan. Jenis data dalam penelitian ini merupakan data sekunder yang diperoleh dari ICMD (*Indonesian Capital Market Directory*). Teknik analisis data menggunakan analisis regresi linier berganda.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa pertama, rasio likuiditas tidak berpengaruh terhadap *return* saham satu tahun ke depan. Kedua, rasio *leverage* tidak berpengaruh terhadap *return* saham satu tahun ke depan. Ketiga, rasio aktivitas berpengaruh signifikan terhadap *return* saham satu tahun ke depan. Keempat, rasio profitabilitas tidak berpengaruh terhadap *return* saham satu tahun ke depan. Kelima, ukuran perusahaan berpengaruh signifikan terhadap *return* saham satu tahun ke depan.

Kata kunci: *Return* Saham, Rasio Likuiditas, Rasio *Leverage*, Rasio Aktivitas, Rasio Profitabilitas, Ukuran Perusahaan