

Abstract: This research aims to know the influence of the ratio profitability, solvability, liquidity, and activity against the stock return with earnings growth as variable moderation. This research was done at the manufacturing companies listed on the Indonesian Stock Exchange 2013-2015 period and use the secondary data. The selection of samples is done by the method of purposive sampling. The data analysis technique is multiple linier regressions analysis and moderated regression analysis with SPSS 23. The results showed in a partial return on assets and debt to equity ratio have positive significant influence, while current ratio and total assets turn over have not effect significant. The result of the F test show all the variables together can affect the stock return. Earning growth as the moderate variable only affect the relationship return on assets against stock return, while debt to equity ratio, current ratio, and total asset turn over have no effect significant.

Keywords: current ratio, total asset turn over, stock return, earning growth

Abstrak: Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh rasio profitabilitas, solvabilitas, likuiditas, dan aktivitas terhadap stock return dengan pertumbuhan laba sebagai variabel moderasi. Penelitian ini dilakukan pada perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2013-2015 dan menggunakan data sekunder. Pemilihan sampel dilakukan dengan metode purposive sampling. Teknik analisis data yang digunakan adalah analisis regresi berganda dan Moderated Regression Analysis dengan menggunakan SPSS 23. Hasil penelitian menunjukkan bahwa secara parsial return on asset dan debt to equity ratio berpengaruh positif signifikan terhadap stock return, sedangkan current ratio dan total asset turn over tidak berpengaruh signifikan terhadap harga saham. Hasil uji F menunjukkan seluruh variabel secara bersama-sama dapat mempengaruhi stock return. Pertumbuhan laba sebagai variabel moderasi hanya dapat mempengaruhi hubungan return on asset terhadap stock return, sedangkan debt to equity ratio, current ratio, dan total asset turn over tidak berpengaruh signifikan.

Kata kunci: current ratio, pertumbuhan laba, stock return, total asset turn over