

## ABSTRAK

Tujuan penelitian ini adalah untuk menganalisa pengaruh faktor fundamental, total asset turnover dan ukuran perusahaan terhadap return. Faktor fundamental, total asset turnover dan ukuran perusahaan digunakan sebagai variabel independen dan *return* saham digunakan sebagai variabel dependen. Data yang digunakan adalah data sekunder berupa laporan keuangan dan *annual report* tahun 2013 sampai 2017. Sampel pada penelitian ini adalah perusahaan manufaktur yang terdaftar di bursa efek indonesia sebanyak 23 perusahaan.

Hasil penelitian menunjukkan faktor fundamental (return on equity, debt to equity ratio), total *asset turnover* (TATO) dan ukuran perusahaan (SIZE) secara simultan berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham. Faktor fundamental return on equity (ROE) secara parsial berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham. Total *asset turnover* (TATO) dan ukuran perusahaan secara parsial tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham.

**Kata Kunci:** *Return* Saham, ROE, DER, TATO dan Ukuran Perusahaan.