

ABSTRAKSI

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisa pengaruh dari *Return on Assets* (ROA), volume perdagangan, *sales growth*, *Price to Book Value* (PBV), dan *Earning per Share* (EPS) terhadap *return* saham. Penelitian ini menggunakan sampel perusahaan-perusahaan manufaktur yang terdaftar di indeks LQ45 periode 2007-2010 sebanyak 98 perusahaan. Pengolahan data berdasarkan *Jakarta Stock Exchange* (JSX) dan *Indonesian Capital Market Directory* (ICMD). Penelitian ini dilakukan dengan menggunakan metode regresi berganda dan f-test.

Hasil dari analisa menunjukkan bahwa *Return on Asset* (ROA) dan *Price to Book Value* (PBV) berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham. *Volume Perdagangan* dan *Earning per Share* (EPS) berpengaruh negatif tetapi tidak signifikan terhadap *return* saham. Sedangkan, *sales growth* berpengaruh negatif dan signifikan terhadap *return* saham.

Kata Kunci: *Return on Asset* (ROA), *Volume Perdagangan*, *Sales Growth*, *Price to Book Value* (PBV), and *Earning Per Share* (EPS), *Return Saham*

Nico Aria Rahardja

11 November 2011