

## ABSTRAK

Tujuan penelitian ini adalah untuk menguji pengaruh ROA, CR, DER, PER, EPS, PBV dan NPM terhadap *Return* Saham. Penelitian ini diambil karena masih terdapat perbedaan penelitian antara penelitian yang satu dengan yang lain serta terdapat perbedaan antara keadaan riil dari data penelitian yang ada.

Penelitian ini dilakukan dengan menggunakan data sekunder. Teknik sampel yang digunakan adalah *purposive sampling*. Dari empat puluh lima, hanya diambil tujuh belas perusahaan, karena memiliki laporan keuangan secara lengkap tahun 2008 – 2012. Variabel yang digunakan dalam penelitian ini adalah *Return* Saham sebagai variabel dependen, serta ROA, CR, DER, PER, EPS, PBV dan NPM sebagai variabel independen. Metode analisis yang digunakan adalah analisis regresi linier berganda yang sebelumnya dilakukan uji asumsi klasik, meliputi uji normalitas, uji multikolinieritas, uji heteroskedastisitas, dan uji autokorelasi. Dan kemudian yang terakhir menggunakan uji  $f$  dan uji  $R^2$ .

Hasil analisis regresi, dapat diketahui bahwa ROA berpengaruh positif dan tidak signifikan terhadap *Return* saham. CR berpengaruh negatif dan tidak signifikan terhadap *Return* saham. DER berpengaruh negatif dan signifikan terhadap *Return* saham. PER berpengaruh negatif dan tidak signifikan terhadap *Return* saham. EPS berpengaruh negatif dan tidak signifikan terhadap *Return* saham. PBV berpengaruh positif dan signifikan terhadap *Return* saham. NPM berpengaruh negatif dan tidak signifikan terhadap *Return* saham. Kemampuan prediksi dari ketujuh variabel terhadap *Return* Saham dalam penelitian ini sebesar 17,9% sedangkan sisanya 82,1% dipengaruhi oleh faktor lain yang tidak dimasukkan ke dalam model penelitian.

Kata kunci : *Return* Saham, ROA, CR, DER, PER, EPS, PBV dan NPM.