

**PENGARUH RETURN ON ASSETS, RETURN ON EQUITY, EARNING PER SHARE, DAN
CURRENT RATIO TERHADAP RETURN SAHAM(Pada Perusahaan Yang Terdaftar Di
Indeks LQ45 Di Bursa Efek Indonesia Tahun 2011-2015)**

**THE EFFECT OF RETURN ON ASSETS, RETURN ON EQUITY, EARNING PER SHARE,
AND CURRENT RATIO ON STOCK RETURN (On Company That Listed On Index LQ45 On
Indonesia Stock Exchange Years 2011-2015)**

Rio Febrioni

febrionirio@gmail.com

Deannes Isyuardhana, SE., M.M.

Muhammad Rafki Nazar, SE.,M.Sc.

ABSTRAK

Beberapa faktor yang dapat mempengaruhi fluktuasi harga saham di pasar modal, hal ini terjadi karena harga saham dapat dipengaruhi oleh faktor eksternal dari perusahaan maupun faktor internal perusahaan. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui ROA, ROE, EPS dan CR terhadap Return Saham. Objek penelitian ini adalah emiten LQ45 yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2011-2015 dan jumlah sampel yang diperoleh sebanyak 18 perusahaan dengan melewati tahap purposive sampling sesuai dengan kriteria yang dibutuhkan untuk penelitian.

Penelitian ini dikategorikan ke dalam jenis penelitian deskriptif dan metode verifikatif. Jenis data yang digunakan dalam penelitian ini termasuk ke dalam jenis data sekunder berupa laporan tahunan dan laporan keuangan perusahaan sejak tahun 2011 hingga tahun 2015 yang dapat diperoleh dari website www.idx.co.id. Metode analisis dari penelitian ini menggunakan analisis regresi data panel untuk memperoleh gambaran yang menyeluruh mengenai hubungan antara variabel satu dengan variabel lainnya.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa ROA, ROE, EPS dan CR memiliki pengaruh yang signifikan terhadap Return saham pada perusahaan. Hasil penelitian ini mengidentifikasi secara parsial Return on Asset (ROA) tidak berpengaruh signifikan terhadap return saham dengan arah pengaruh yang positif, Return on Equity (ROE) tidak berpengaruh signifikan terhadap return saham dengan arah pengaruh yang positif, Earning Per Share (EPS) berpengaruh signifikan terhadap return saham dengan arah pengaruh yang positif dan Current Ratio (CR) tidak berpengaruh signifikan terhadap return saham dengan arah pengaruh yang negatif pada perusahaan yang terdaftar Indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia periode 2011-2015.

Kata Kunci : ROA, ROE, EPS dan CR dan Return saham

ABSTRACT

Several factors that can affect fluctuations stock prices capital market , this is because the stock prices can be influenced by both external factors the internal factors of company .Research aims to understand roa , roe , caused and cr to Stocks Return .Object this research is issuers lq45 listed on the indonesian stock exchange the period 2011-2015 and the sample of the obtained about 18 company with pass through the purposive sampling in accordance with the criteria needed.

This research are classified in the descriptive research and verifikatif methods. The kind of data that used in this research is a secondary data in the form of the annual report and the financial reports of companies in 2011 until 2015 which can be obtained from www.idx.co.id website. The method of analysis of the research is regression analysis using data panel to obtain paints a thorough on the relationship between variables one with other variables

This research result indicates that roa, roe, eps and cr having influence a significant impact on stock return in companies. The result of this research identify in partial return on assets (roa) do not affect significantly to stock return to the positive influence, return on equity (roe) not significant to return stock to the positive influence, earning per share (eps) caused significant influence to stock return positively and current ratio (cr) not significant to stock return negatively to companies that registered index lq45 at the indonesian stock exchange the period 2011-2015.