ABSTRAK

Setiap investor dalam menanamkan modalnya, selalu mengharapkan *return* saham yang tinggi. Oleh karena itu, investor harus dapat menganalisis laporan keuangan dengan baik sehingga dapat mempermudah dalam pengambilan keputusan. Dari laporan keuangan tersebut diperoleh informasi tentang kinerja keuangan yang dapat digunakan sebagai dasar penilaian untuk memilih saham-saham yang mampu memberikan tingkat pengembalian *(return)* yang tinggi.

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh *earning per share, price earning ratio,* dan *dividen payout ratio* secara simultan dan parsial terhadap *return* saham.

Penelitian ini menggunakan populasi perusahaan yang terdaftar dalam Indeks Sektor *Property* dan *Real Estate* periode tahun 2011-2013 di Bursa Efek Indonesia, dengan pemilihan sampel menggunakan *purposive sampling* didapatkan sampel sebanyak 17 perusahaan. Metode analisis dari penelitian ini menggunakan analisis regresi data panel.

Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwa secara simultan *earning per share, price earning ratio,* dan *dividen payout ratio* berpengaruh signifikan terhadap *return* saham. Hasil penelitian ini juga menunjukkan bahwa secara parsial *earning per share* dan *price earning ratio* berpengaruh signifikan terhadap *return* saham, sementara *dividen payout ratio* tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham.

Kata kunci: *earning per share, price earning ratio, dividen payout ratio, return* saham