

ABSTRACT

This research is done to analyze the influence of Return on Equity (ROE) and Earning per Share (EPS) toward the return saham in companies which are registered in Bursa Efek Indonesia in 2010-2013. The sampling technique that is used is purposive sampling and using 48 companies as the samples. Variables that are used in this research are Return on Equity (ROE) variable and Earning per Share (EPS) as independent variable; while return saham as dependent variable. Analysis technique which is used in this research is multiple linear regression and hypothesis test, also classic assumption test consists of normality test, multi-collinearity test, autocorrelation test and heteroskedastisitas test. The result of this research shows the positive influences of Return on Equity (REO) and Earning per Share (EPS) toward return saham.

Keywords : Return Saham, Return On Equity (ROE) and Earning Per Share (EPS).

SARIPATI

Penelitian ini dilakukan untuk menganalisis pengaruh Return On Equity (ROE) dan Earning Per Share (EPS) terhadap return saham pada perusahaan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2010-2013. Teknik sampling yang digunakan adalah purposive sampling dan jumlah sampel yang digunakan sebanyak 48 perusahaan. Variabel yang digunakan dalam penelitian ini adalah variabel Return On Equity (ROE) dan Earning Per Share (EPS) sebagai variabel independen; return saham sebagai variabel dependen. Teknik analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah regresi linear berganda dan uji hipotesis. Selain itu juga dilakukan uji asumsi klasik yang meliputi uji normalitas, uji multikolinieritas, uji heteroskedastisitas dan uji autokorelasi. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa Return On Equity (ROE) dan Earning Per Share (EPS) berpengaruh positif terhadap return saham.

Kata kunci : Return Saham, Return On Equity (ROE) dan Earning Per Share (EPS).