

ABSTRAK

Return saham merupakan hasil yang diperoleh dari investasi saham. Tujuan utama investor menginvestasikan dananya yaitu mendapatkan return tinggi. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh EPS, ROA dan PER terhadap Return saham perusahaan manufaktur otomotif sub sektor ban dan spare-part yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) Periode 2012 baik secara simultan maupun parsial. Metode penelitian yang digunakan adalah metode penelitian deskriptif dan verifikatif dengan jumlah sampel sebanyak 10 perusahaan. Metode analisis data yang digunakan adalah analisis regresi berganda, uji asumsi klasik, korelasi berganda, koefisien determinasi dan uji hipotesis.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa EPS, ROA dan PER memiliki pengaruh secara simultan pada signifikansi 0,000 dan $F_{hitung} \geq F_{tabel}$ ($29,026 \geq 2,786$) Secara parsial EPS berpengaruh positif terhadap return saham pada signifikansi 0,000 dan $T_{hitung} \geq T_{tabel}$ ($4,684 > 2,008$) ROA berpengaruh positif terhadap return saham pada signifikansi 0,000 dan $T_{hitung} \geq T_{tabel}$ ($4,166 > 2,008$) dan PER berpengaruh positif terhadap return saham pada signifikansi 0,000 dan $T_{hitung} \geq T_{tabel}$ ($5,129 > 2,008$). Besarnya pengaruh EPS, ROA dan PER terhadap return saham secara simultan adalah 63,1% dan besarnya pengaruh secara parsial EPS adalah 20,8%, ROA adalah 16,4% dan PER adalah 25,9%.

Kata kunci : Earning per share (EPS), Return on Asset (ROA), Price Earning Ratio (PER), Return saham

ABSTRACT

Stock return is the result which has been obtained from stock investment. The primary objective of investors is to invest their fund in order to earn high return. This research is meant to find out the influence of EPS, ROA and PER on Stock return manufacturing companies subsector tire and spare-part which are listed on Indonesia Stock Exchange in 2012 – 2016 period both simultaneously or partially. The method of research is using descriptive and verification with 10 firm as sample research. The data analysis method is using multiple linier regression analysis, the classic assumption test multiple correlation analysis, coefficient of determination, and hypothesis testing.

The result showed that EPS, ROA and PER have influence simultaneously on Stock Return at significance 0,000 and $F_{count} \geq F_{table}$ ($29,026 \geq 2,786$). EPS partially has positive influence on Stock Return at significance 0,000 and $T_{count} \geq T_{table}$ ($4,684 > 2,008$) ROA partially has positive influence on Stock Return at significance 0,000 and $T_{count} \geq T_{table}$ ($4,166 > 2,008$) while PER partially has positive influence on Stock Return at significance 0,000 and $T_{count} \geq T_{table}$ ($5,129 > 2,008$). The amount of influence of EPS, ROA and PER on Stock return simultaneously is 62,2% while partially the amount of influence of EPS is 20,8%, ROA is 16,4% and 25,9% for PER.

Keywords : Earning per share (EPS), Return on Asset (ROA), Price Earning Ratio (PER), Stock Return

