

**PENGARUH KARAKTERISTIK PERUSAHAAN TERHADAP RETURN
SAHAM (STUDI PADA PERUSAHAAN KELOMPOK LQ45
DI BURSA EFEK INDONESIA)**

BY :

SOFI HATIHAH

43208110446

ABSTRAKSI

Penelitian ini bertujuan untuk menjelaskan pengaruh Karakteristik perusahaan (Ukuran Perusahaan, *Earnings Per Share*, *Price to Book Value*, Profitabilitas, *Leverage*) terhadap Return saham LQ-45 baik secara simultan maupun parsial di BEI. Sampel yang digunakan dalam penelitian ini adalah perusahaan yang tergabung dalam perusahaan LQ-45 yang terdaftar di BEI selama periode 2008-2011. Model Analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah regresi linear berganda.

Nilai *Adjusted R Square* sebesar 0.289 yang diperoleh dari karakteristik perusahaan yang di proksikan dengan *Size*, EPS, PBV, ROA, DER. Hasil penelitian secara parsial hanya variable EPS yang berpengaruh signifikan terhadap *return* saham.

Hasil penelitian ini menyatakan bahwa terdapat pengaruh yang signifikan antara Karakteristik Perusahaan terhadap return saham yang diwakilli oleh variabel *Size*, EPS, PBV, ROA, dan DER.

Kata kunci : *Size*, EPS, PBV, ROA, DER, *Return* Saham

THE EFFECT of COMPANY CHARACTERISTIC to STOCK RETURN
(STUDY CASE LQ45 COMPANY in IDX)

BY :

SOFI HATIJAH

43208110446

ABSTRACT

This study aimed to clarify the effect of company characteristics (size company, Earnings Per Share, Price to Book Value, ROA, DER) to stock Return of the LQ-45 Company either simultaneously or partially in IDX. The sample used in this study is a company incorporated in the LQ-45 firms listed on the Stock Exchange during the period 2008-2011. Analysis of the model used in this study is a multiple linear regression.

Adjusted R Square values for 0.289 were obtained from the characteristics of the companies that represent by Size, EPS, PBV, ROA, DER. The results partially EPS only variable that significantly influence stock returns.

Results of this study suggest that there is significant relationship between characteristics of the Company's stock return variable represent by Size, EPS, PBV, ROA, and DER.

Keywords : Size, EPS, PBV, ROA, DER, Return