

## **ABSTRAK**

Penelitian ini dilakukan untuk menguji pengaruh beberapa faktor fundamental berupa variabel *Return On Equity*, *Earning Per Share*, *Total Asset Turn Over*, *Return On Asset*, *Debt To Equity Ratio*, *Current Ratio* dan *Financial Leverage* terhadap *return* saham. Teknik sampling yang digunakan adalah *purposive sampling* dengan kriteria (1) Perusahaan sektor pertambangan yang terdaftar di BEI periode tahun 2008-2011 dan mewakili sub sektor pertambangan. (2) Perusahaan pertambangan tersebut tidak pernah *delisting* pada periode tahun 2008-2011. (3) Mempublikasikan laporan keuangannya di Bursa Efek Indonesia. Data diperoleh berdasarkan publikasi Bursa Efek Indonesia. Diperoleh jumlah sampel sebanyak 11 perusahaan dari 31 perusahaan yang terdaftar di BEJ. Teknik analisis yang digunakan adalah regresi berganda dan uji hipotesis menggunakan t-statistik untuk menguji koefisien regresi parsial serta f statistik untuk menguji keberartian pengaruh secara bersama-sama dengan *level of significance* 5%. Selain itu juga dilakukan uji asumsi klasik yang meliputi uji normalitas, uji multikolinieritas, uji heteroskedastisitas dan uji autokorelasi. Berdasarkan hasil penelitian tidak ditemukan variabel yang menyimpang dari asumsi klasik, hal ini menunjukkan bahwa data yang tersedia telah memenuhi syarat untuk menggunakan model persamaan regresi linier berganda. Dari hasil uji t atau uji parsial diperoleh bahwa variabel *Return On Equity*, *Earning Per Share*, *Return On Asset*, *Debt To Equity Ratio*, dan *Current Ratio* berpengaruh signifikan terhadap tingkat *return* saham, sedangkan variabel *Total Asset Turn Over* dan *Financial Leverage* tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham. Sedangkan secara bersama-sama variabel *Return On Equity*, *Earning Per Share*, *Return On Asset*, *Debt To Equity Ratio*, dan *Current Ratio*, *Total Asset Turn Over* dan *Financial Leverage* terbukti signifikan berpengaruh terhadap *return* saham perusahaan di BEJ. Kemampuan prediksi atau Koefisien Determinasi (R<sup>2</sup>) dari ketujuh variabel tersebut terhadap *return* saham sebesar 29,4 %. Hasil Penelitian ini menunjukkan bahwa kinerja faktor fundamental perusahaan, digunakan oleh investor untuk memprediksi *return* saham perusahaan pertambangan yang listed di Bursa Efek Indonesia periode tahun 2008 – 2012.

Kata Kunci : Analisis Fundamental, ROA, EPS, ROE, DER, CR, TATO, FL, dan Return Saham.