

## ABSTRAKSI

Penelitian ini bertujuan untuk mengungkapkan bagaimana pengaruh fundamental perusahaan yaitu *Earning Per Share* (EPS) dan *Return On Equity* (ROE) terhadap *Return Saham*. Sampel dalam penelitian ini adalah semua perusahaan yang masuk dalam perhitungan LQ-45 tahun 2005-2008, dan memenuhi kriteria pemilihan sampel sehingga diperoleh sampel sebanyak 13 perusahaan. Data yang digunakan berasal dari laporan keuangan masing-masing perusahaan pada tahun 2005-2008.

Penelitian ini menggunakan analisis regresi linear berganda, pengujian dilakukan dengan Uji F dan Uji t dan Uji  $R^2$  (Koefisien Determinan). Pengolahan data dilakukan dengan menggunakan program *SPSS 16.0 for windows*.

Hasil analisis menunjukkan bahwa secara simultan variabel independent berpengaruh signifikan terhadap variabel dependent sebesar 81,9%. Hal ini berarti *Return Saham* lebih banyak dipengaruhi oleh variabel lain yang tidak termasuk dalam penelitian ini.

Analisis secara parsial sama halnya dengan uji simultan variabel independent yaitu *Earning Per Share* (EPS) dan *Return On Equity* (ROE) berpengaruh signifikan terhadap variabel dependent, pada derajat kepercayaan 5% ( $\alpha = 0,05$ ).

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