

ABSTRAK

Skripsi ini membahas bagaimana pengaruh *Return On Assets* (ROA) dan *Return On Equity* (ROE) terhadap *Return* saham. Yang menjadi Obyek dalam penelitian ini adalah PT. Gudang Garam Tbk. Data yang digunakan berasal dari laporan keuangan triwulan PT. Gudang Garam Tbk periode 2003-2009.

Penelitian ini menunjukkan analisis regresi linier berganda, pengujian dilakukan dengan Uji F dan Uji t dan Uji R² (Koefisien Determinan). Pengolahan data dilakukan dengan menggunakan program *SPSS 17.00 for Windows*.

Hasil pengujian hipotesis menunjukkan secara parsial ROA dan ROE terdapat pengaruh yang signifikan terhadap *return* saham pada derajat kepercayaan 5% ($\alpha = 0.05$) dan secara simultan ROA dan ROE juga berpengaruh signifikan terhadap *return* saham.

Hasil pengujian koefisien Determinan (R²) menunjukkan bahwa variabel independen berpengaruh signifikan terhadap variabel sebesar 27.20%. Hal ini berarti *return* saham lebih banyak dipengaruhi oleh variabel lain yang tidak termasuk dalam penelitian ini.

Kata Kunci : *Return On Assets* (ROA) dan *Return On Equity* (ROE) dan *Return Saham*.