

**ANALISIS PENGARUH *RETURN ON EQUITY (ROE)*, *PRICE EARNING RATIO (PER)*, DAN *DEBT TO EQUITY RATIO* TERHADAP RETURN SAHAM PERUSAHAAN YANG TERMASUK KEDALAM LQ45 TAHUN 2010 – 2014**

Oleh :

Anisa Nurfajriah

43113110282

**ABSTRACT**

Penelitian ini dilakukan untuk menguji pengaruh *Return on Equity (ROE)*, *Price Earning Ratio (PER)*, dan *Debt to Equity Ratio (DER)* terhadap *return* saham. Teknik pengambilan sampel yang digunakan adalah purposif sampling dan didapatkan 28 perusahaan dari 87 perusahaan yang tergabung dalam indeks LQ45 pada periode 2010 sampai dengan 2014.

Teknik yang digunakan untuk mengetahui hasil penelitian menggunakan uji asumsi klasik, regresi beranda, dan uji hipotesis yang terdiri dari uji F dan uji t. Untuk hasil uji F diketahui bahwa ROE, PER, dan DER bersama-sama berpengaruh signifikan terhadap *return* saham. Sedangkan untuk uji t ROE tidak berpengaruh secara signifikan terhadap *return* saham dan variabel PER dan DER dengan hasil t hitung lebih besar dari t tabel sebesar 1,977 dengan nilai signifikan lebih kecil dengan batas signifikan 5%. Dapat ditarik kesimpulan PER dan DER berpengaruh secara signifikan terhadap *return* saham.

**Kata Kunci :** *Return on Equity (ROE)*, *Price Earning Ratio (PER)*, *Debt to Equity Ratio (DER)*, LQ45, *return* saham

***ANALYSIS OF EFFECT OF RETURN ON EQUITY (ROE), PRICE  
EARNINGS RATIO (PER), AND DEBT TO EQUITY RATIO (DER)  
TO RETURN STOCK INTO COMPANY INDEX  
LQ45 IN PERIODE 2010-2014***

by:

Anisa Nurfajriah

43113110282

**ABSTRACT**

*This study was conducted to examine the effect of Return on Equity (ROE), Price Earning Ratio (PER), and Debt to Equity Ratio (DER) to stock return. The sampling technique which is used is purposive sampling and got 28 companies out of 87 companies belonging to the LQ45 index in the period 2010 to 2014.*

*The technique used to determine the results of studies using classic assumption test, regression veranda, and hypothesis testing consisting of F test and t test. For the F test results known that ROE, PER, and DER together - significant effect on stock returns. As for the t test ROE no significant effect on stock returns and PER and DER variables with the results of the t is greater than t table of 1.977 to segnifikan value by significantly limit of 5%. It can be deduced PER adn DER significant effect on stock returns.*

***Keywords: Return on Equity (ROE), Price Earning Ratio (PER), Debt to Equity Ratio (DER), LQ45, stock returns***