

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh variabel fundamental (ROA, ROE, BV, DPR, DER dan EPS) terhadap return saham, baik secara parsial maupun secara simultan. Obyek penelitian adalah saham LQ45 pada Bursa Efek Indonesia untuk periode 2005-2007. Metode penelitian yang digunakan adalah penelitian kuantitatif. Teknik pengumpulan data menggunakan teknik *non-probability sampling* atau *purposive sampling*.

Teknik pengolahan data yang digunakan adalah metode regresi linear berganda. Hasil penelitian menunjukkan bahwa secara simultan bahwa nilai R^2 45.8% dan nilai uji F signifikansi 0.000, yang berarti terdapat pengaruh variabel fundamental terhadap return saham. Secara parsial, variabel BV berpengaruh signifikan terhadap return saham, sedangkan pengaruh variabel ROE, ROA, DPR, DER dan EPS tidak signifikan. Untuk penelitian selanjutnya disarankan untuk menambah tahun pengamatan, jumlah variabel independen dan faktor makro seperti kurs, inflasi, perubahan suku bunga agar mendapat gambaran yang lebih baik.