

## **ABSTRACT**

*The purpose of this research is to test the effect of Return On Equity (ROE), Debt to Equity Ratio (DER), Earning Per Share (EPS), Price Earning Ratio (PER) to stock return. The population in this study are the banking sector company listed on the Indonesia Stock Exchange (IDX) for the period of 2012-2016. The data sources used come from the secondary data type where the data sources are taken from annual financial report (balance sheet of income statement and stock days trading report). The number of research samples of 19 companies determined by the purposive sampling technique. The analysis technique used is time series data regression analysis technique by using SPSS 24. Based on the analysis result, it is concluded that Return On Equity (ROE), Price Earning Ratio (PER) have positive and significant effect to stock return. Earning Per Share have a negative and significant effect on stock return. Debt to Equity Ratio has negative and insignificant effect on stock return.*

**Keyword:** *Stock Return, Return On Equity, (ROE), Debt to Equity Ratio (DER), Earning Per Share (EPS), Price Earning Ratio (PER).*



UNIVERSITAS  
MERCU BUANA

## ABSTRAK

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk menguji pengaruh *Return On Equity*, (ROE), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Earning Per Share* (EPS), *Price Earning Ratio* (PER) terhadap *return* saham. Populasi dalam penelitian ini adalah perusahaan sektor perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) pada tahun 2012-2016. Sumber data yang digunakan berasal dari jenis data sekunder dimana sumber data berupa laporan keuangan tahunan yang telah dipublikasikan (neraca laporan laba rugi dan laporan jumlah hari perdagangan saham). Jumlah sampel penelitian sebanyak 19 perusahaan yang ditentukan dengan teknik *purposive sampling*. Teknik analisis yang digunakan adalah teknik analisis regresi data *time series* dengan menggunakan bantuan aplikasi SPSS versi 24. Berdasarkan hasil analisis diperoleh kesimpulan bahwa *Return On Equity* (ROE), *Price Earning Ratio* (PER) berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham. *Earning Per Share* berpengaruh negatif dan signifikan terhadap *return* saham. *Debt to Equity Ratio* berpengaruh negatif dan tidak signifikan terhadap *return* saham.

**Katakunci:** *Return Saham, Return On Equity*, (ROE), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Earning Per Share* (EPS), *Price Earning Ratio* (PER).



UNIVERSITAS  
MERCU BUANA