

ABSTRACT

This study aims to examine and analyze the influence of factors (ROA, DER, EPS, PER) on stock returns of finance companies listed on the Indonesia Stock Exchange. The research data is annual financial statement data for the 5-year observation period (2012-2016). From this study took a sample of 12 finance companies listed on the Indonesia Stock Exchange (IDX), for the period 2012 to 2016. The analytical method used in this study was panel data regression. The results of the research partially show that EPS has a significant effect on stock returns and ROA, DER, and PER show no significant effect on stock returns. Taken together (simultaneous) showing ROA, DER, EPS, PER has a significant effect on Return shares. The results of this study indicate that fundamental performance factors of earnings per share (EPS) are used by investors to predict stock returns of finance companies listed on the Indonesia Stock Exchange in the period 2012-2016.

Key Word : *Return On Asset, Debt To Equity Ratio, Earning Per Share, Price Earning Ratio and Stock Return*

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan menguji dan menganalisis pengaruh faktor (ROA, DER, EPS, PER) terhadap *return* saham perusahaan pembiayaan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Data penelitian merupakan data tahunan laporan keuangan untuk periode observasi 5 tahun (2012-2016). Dari Penelitian ini mengambil sampel sebanyak 12 perusahaan pembiayaan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI), untuk periode tahun 2012 sampai dengan 2016. Metode analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah regresi data panel. Hasil Penelitian secara parsial menunjukkan EPS berpengaruh Signifikan Terhadap *Return* saham dan ROA, DER, serta PER menunjukkan tidak berpengaruh signifikan Terhadap *Return* saham. Secara bersama-sama (simultan) menunjukkan ROA, DER, EPS, PER berpengaruh secara signifikan terhadap *Return* saham. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa faktor kinerja fundamental laba per saham (EPS) yang digunakan oleh investor untuk memprediksi *return* saham perusahaan pembiayaan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia pada periode 2012 - 2016.

Kata kunci: *Return On Asset, Debt To Equity Ratio, Earning Per Share, Price Earning Ratio and Stock Return*