

ABSTRAK

PENGARUH PROFITABILITAS, *LEVERAGE*, DAN UKURAN PERUSAHAAN TERHADAP *RETURN SAHAM* (Studi Pada Perusahaan LQ-45 Di Bursa Efek Indonesia)

Oleh

VERA PUSPITA

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui apakah terdapat pengaruh signifikan dari rasio-rasio keuangan (*Return on Asset*, *Price Earning Ratio*, *Debt to Equity Ratio*, dan Ukuran Perusahaan) terhadap *return* saham pada perusahaan yang terdaftar di BEI dan masuk dalam index LQ-45 secara berturut-turut tahun 2007-2011.

Pemilihan sampel dalam penelitian ini diperoleh dengan menggunakan metode *purposive judgment sampling*. Berdasarkan kriteria yang ada, maka didapat 15 perusahaan sampel penelitian. Pengujian hipotesis dilakukan dengan menggunakan analisis regresi linear berganda, namun sebelumnya dilakukan uji asumsi klasik terlebih dahulu.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa dari empat variabel yang diuji, yaitu: *Return on Asset*, *Price Earning Ratio*, *Debt to Equity Ratio*, dan Ukuran perusahaan, hanya variabel *Price Earning Ratio* yang memiliki pengaruh signifikan terhadap *return* saham, sedangkan tiga variabel lainnya, yaitu: *Return on Asset*, *Debt to Equity Ratio*, dan Ukuran perusahaan tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham.

Kata kunci: *Return on Asset*, *Price Earning Ratio*, *Debt to Equity Ratio*, Ukuran Perusahaan, *Return Saham*.

ABSTRAK

PENGARUH PROFITABILITAS, *LEVERAGE*, DAN UKURAN PERUSAHAAN TERHADAP *RETURN* SAHAM

(Studi Pada Perusahaan LQ-45 Di Bursa Efek Indonesia)

Oleh

VERA PUSPITA

This research aimed to determine whether there is a significant effect of financial ratios (Return on Assets, Price Earning Ratio, Debt to Equity Ratio, and the size of the Company) towards the stock return on the companies listed on the Stock Exchange and in the LQ-45 index respectively consecutive years 2007-2011.

The sample in this research were obtained by using purposive judgment sampling. Based on the criteria, it acquired 15 companies sample. Hypothesis testing is performed using multiple linear regression analysis, but previously performed classical assumption test first.

The results showed that of the four variables tested, namely: Return on Assets, Price Earning Ratio, Debt to Equity Ratio, and firm size, only the Price Earning Ratio variable that have a significant effect towards stock returns, while the other three variables, namely: Return on Assets, Debt to Equity Ratio, and the firm size does not have a significant effect towards stock return.

Key Words: Return on Asset, Price Earning Ratio, Debt to Equity Ratio, Firm Size, Return Saham.