ABSTRAKSI

Henny Setyaningrum, 152100045, Program Studi Ilmu Administrasi Bisnis, Fakultas Ilmu Sosial dan Ilmu Politik, Universitas Pembangunan Nasional "Veteran" Yogyakarta, "Analisis Pengaruh ROA *(Return On Asset)*, ROE *(Return On Equity)* dan DER *(Debt to Equity Ratio)* Terhadap *Return* Saham Pada Perusahaan Sektor Pertanian yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) Periode 2010-2014". Pembimbing Didik Indarwanta,M.AB dan Sauptika Kancana, M.Si.

Kegiatan investasi merupakan suatu kegiatan menempatkan dana satu atau lebih aset selama periode tertentu dengan harapan dapat memperoleh pendapatan atau peningkatan atas nilai investasi awal (modal) yang bertujuan untuk memaksimalkan hasil *(return)* yang diharapkan dalam batas resiko yang dapat diterima untuk tiap investor. Investor dalam menanamkan dananya membutuhkan berbagai informasi yang berguna untuk memprediksi hasil investasinya dalam pasar modal. Salah satu informasi yang digunakan investor untuk memprediksi keuntungan (*return* saham) adalah informasi tentang resiko keuangan seperti ROA *(Return On Asset)*, ROE *(Return On Equity)*, DER *(Debt to Equity Ratio)* terhadap *return* saham pada Perusahaan Sektor pertanian yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2010-2014. Penelitian ini diharapkan bermanfaat bagi investor yang dapat memberikan informasi dan referensi tambahan sebagai bahan pertimbangan dalam membeli saham pada suatu perusahaan.

Tipe penelitian yang digunakan dalam penelitian ini adalah *Explanatory Research* yang menjelaskan hubungan kausal antara variabel satu dengan variabel lainnya dengan hipotesis dan pendekatan kuantitatif. Populasi dalam penelitian ini adalah Perusahaan Sektor Pertanian yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2010-2011 sebanyak 15 perusahaan. Sedangkan teknik sampling yang digunakan oleh peneliti dalam penelitian ini adalah teknik pengambilan sampel dengan cara *purposive sampling* dengan jumlah sampel sebanyak 9 perusahaan. Sumber data dalam penelitian ini berasal dari data sekunder yang berasal dari data laporan keuangan perusahaan. Teknik analisis data yang digunakan dalam penelitian ini adalah Analisis Regresi Linear Berganda.

Hasil penelitian meunjukkan bahwa ROA *(Return On Asset)*, ROE *(Return On Equity)*, DER *(Debt to Equity Ratio)* secara simultan maupun parsial tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham pada Perusahaan Sektor Pertanian yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia.