

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh *Return on Assets* (ROA), *Capital Adequacy Ratio* (CAR), *Earning Per Share* (EPS), dan *Loans to Deposite Ratio* (LDR) terhadap *return* saham perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) tahun 2011-2013. Populasi dalam penelitian ini adalah seluruh perusahaan perbankan yang terdaftar di BEI tahun 2011-2013. Penentuan sampel dengan menggunakan teknik *purposive sampling*. Sampel penelitian ini sebanyak 29 perusahaan perbankan yang memenuhi kriteria. Metode pengumpulan data berupa teknik dokumentasi dan analisis linier berganda sebagai teknik analisis. Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwa *Return on Assets* (ROA), *Capital Adequacy Ratio* (CAR), *Earning Per Share* (EPS), *Loans to Deposite Ratio* (LDR) berpengaruh secara simultan terhadap *return* saham. Berdasarkan hasil uji parsial *Return on Assets* (ROA) berpengaruh terhadap *return* saham, *Capital Adequacy Ratio* (CAR) tidak berpengaruh terhadap *return* saham, *Earning Per Share* (EPS) tidak berpengaruh terhadap *return* saham, *Loans to Deposite Ratio* (LDR) tidak berpengaruh terhadap *return* saham. Saran yang dapat diberikan adalah penelitian selanjutnya diharapkan dapat menambah variabel independen lainnya yang dapat mengukur tingkat kesehatan bank yang nantinya juga akan berpengaruh terhadap *return* saham.

Kata Kunci: pengaruh *Return on Assets* (ROA), *Capital Adequacy Ratio* (CAR), *Earning Per Share* (EPS), dan *Loans to Deposite Ratio* (LDR) dan *return* saham.

ABSTRACT

This study aims to determinate the effect of Return on Assets (ROA), Capital Adequancy Ratio (CAR), Earning Per Share (EPS), and Loans to Deposite Ratio (LDR) to return the banking company's shares are listed on the Indonesia Stock Exchange (BEI) in 2011-2013. Determination of sample using purposive sampling techniques. The sample in this study is 29 banking companies as the criteria. The results of this study indicate that the Return on Assets (ROA), Capital Adequancy Ratio (CAR), Earning Per Share (EPS), and Loans to Deposite Ratio (LDR) simultaneous significant effect on stock returns, based on the test result partially Return on Assets influence on stock returns, while Capital Adequancy Ratio (CAR) has no effect to stock return, Earning Per Share (EPS) has no effect to stock return, and Loans to Deposite Ratio (LDR) has no effect to stock return. Advice can be given, future studies are epected to add another independent variable that can measure the soundness of banks will also be an effect on stock returns.

Keywords: Return on Assets (ROA), Capital Adequancy Ratio (CAR), Earning Per Share (EPS), Loans to Deposite Ratio (LDR) and stock return.