

## ABSTRAK

Penelitian mengenai *return* saham yang telah dilakukan di banyak Negara dan dalam banyak aspek, namun penelitian *return* saham di Indonesia masih terbatas. Hasil penelitian terdahulu juga memiliki banyak perbedaan. Penelitian ini bertujuan untuk menguji pengaruh ROA, EPS dan DER terhadap *return* saham perusahaan LQ45.

Penelitian ini menggunakan rasio keuangan dengan proksi ROA, EPS dan DER terhadap *return* saham perusahaan LQ45. Sampel penelitian yang digunakan adalah perusahaan LQ45 yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) tahun 2011-2013. Pengumpulan data penelitian menggunakan *purposive sampling*. Data yang diperoleh berjumlah 60 observasi. Penelitian ini menggunakan regresi linier berganda untuk menghasilkan data.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa DER berpengaruh terhadap *return* saham, sedangkan ROA dan EPS tidak berpengaruh terhadap *return* saham.

Kata Kunci: *Return on Assets* (ROA), *Earning per Share* (EPS), *Debt to Equity Ratio* (DER) dan *Return Saham*.