

Analisis Pengaruh Rasio Earning Per Share, Return On Equity dan BI Rate Terhadap Return Saham pada Perusahaan LQ-45 yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2011-2015

LIA DWI JAYANTI

(Pembimbing : Dr. Herry Subagyo, MM)

Manajemen - S1, FEB, Universitas Dian Nuswantoro

www.dinus.ac.id

Email : 211201302983@mhs.dinus.ac.id

ABSTRAK

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk menganalisis pengaruh rasio earning per share (EPS), return on equity (ROE) dan BI rate terhadap return saham. Populasi dalam penelitian ini adalah perusahaan LQ-45 yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia pada periode 2011-2015. Data yang digunakan dalam penelitian ini diperoleh dari Indonesian Capital Market Directory (ICMD) dan Bank Indonesia. Pengambilan sampel menggunakan metode purposive sampling, dengan jumlah 96 sampel. Teknik analisis yang digunakan untuk menguji hipotesis adalah analisis regresi linier berganda. Hasil analisis dari penelitian ini yaitu rasio earning per share (EPS) berpengaruh signifikan dan memiliki arah negatif terhadap return saham, return on equity (ROE) berpengaruh signifikan dan memiliki arah negatif terhadap return saham, dan BI rate berpengaruh signifikan dan memiliki arah positif terhadap return saham.

Kata Kunci : earning per share, return on equity, BI rate dan return saham.

**The Analysis of the Influence of Earning Per Share, Return On Equity
and BI Rate Ratios on Stock Returns in LQ-45 Companies Listed on
Indonesia Stock Exchange Over the Period 2011-2015**

LIA DWI JAYANTI

(Lecturer : Dr. Herry Subagyo, MM)

*Bachelor of Management - S1, Faculty of Economy &
Business, DINUS University*

www.dinus.ac.id

Email : 211201302983@mhs.dinus.ac.id

ABSTRACT

The purpose of this research is to analyze the influence of earning per share (EPS), return on equity (ROE) and BI rate on stock returns. The population in this research is LQ-45 company listed on the Indonesia Stock Exchange over the period 2011-2015. The data used in this research were obtained from Indonesian Capital Market Directory (ICMD) and Indonesia Bank. The samplings are collected by using purposive sampling method, with the number of 96 samples. The analysis technique to test the hypothesis is multiple linear regression analysis. The analysis result of this research are the ratio of earning per share (EPS) has a significant influence and has a negative direction on stock return, return on equity (ROE) has a significant influence and has a negative direction on stock return, and BI rate has a significant influence and has a positive direction on stock return.

Keyword : earning per share, return on equity, BI rate and stock return.