

ABSTRACT

Mada'l Duta Mahardika, Influence of return on asset, earning per share, economic value added, and beta on stock return of listed foods and beverages firms in Indonesia Stock Exchange (IDX) from 2011-2015. Guided by Drs. Ec. Makhmud Zulkifli, .MSi and Prasetyo Nugroho, S.Pi, M.M.z .

The purpose of this research is to analyze the influence of return on asset, earning per share, economic value added, and beta on stock return. The data used of this research is found by the financial report of listed foods and beverages firms in Indonesia Stock Exchange (IDX) from 2011-2015.

This research uses the qualitative approach and secondary data by using the purposive sampling and get for 8 of the 51 sample firms.

The method used is the classical assumption analysis, the multiple linear regression analysis, the F-test, the t-test, and the coefficient of determination test. The result of the variable analysis of return on asset has negative and insignificant influence because t-value is -0,037 and sig-score is 0,373 which is bigger than 0,05. The earning per share has positive and insignificant influence because t-value is 3,312 and sig-score is 0,737 which is bigger than 0,05. The economic value added has negative an insignificant influence because t-value is -2,854 and sig-score 0,648 which is bigger than 0,05. The beta has negative and significant influence because t-value is -0,006 and sig-score 0,019 which is smaller than 0,05. And all four free variables simultaneously are return on asset, earning per share, economic value added, and beta are insignificantly influence on the stock return of the food and beverages firms because significant value and hypothesis test have 0,181 more than 0,05 in the listed food and beverages firms in Indonesia Stock Exchange (IDX) from 2011-2015.

Key Words : return on asset, earning per share, economic value added, beta, stock return

ABSTRAK

Mada'I Duta Mahardika, Pengaruh Return On Asset, Earning Per Share, Economic Valu Added, dan Beta Terhadap Return Saham Perusahaan Makanan dan Minuman yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2011-2015. Di bawah bimbingan Bapak Drs. Ec. Makhmud Zulkifli, Msi dan Prasetyo Nugroho, S.Pi, M.M.

Tujuan Penelitian ini untuk menganalisa Pengaruh Return On Asset, Earning Per Share, Economic Valu Added, dan Beta Terhadap Return Saham. Data yang di gunakan dalam penelitian ini di peroleh dari laporan keuangan Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) Tahun 2011-2015.

Penelitian ini menggunakan pendekatan kuantitatif dan menggunakan data sekunder dengan menggunakan purposive sampling sehingga diperoleh sampel 8 perusahaan dari jumlah populasi sebanyak 51 perusahaan.

Metode yang digunakan adalah analisis uji asumsi klasik, analisis regresi linear berganda, uji f, uji t dan uji koefisien determinasi. Hasil analisis variabel *return on asset* (ROA) memiliki pengaruh negatif tidak signifikan dengan nilai koefisien -0,037 dan signifikansi 0,373 diatas 0,05. *Earning per share* (EPS) memiliki pengaruh positif tidak signifikan dengan nilai koefisien 3,312 dan signifikan 0,737 diatas 0,05. *Economic Value Added* (EVA) memiliki pengaruh negatif tidak signifikan dengan koefisien -2,854 dan signifikan 0,648 diatas 0,05. Beta memiliki pengaruh negatif signifikan dengan koefisien 0,006 dan signifikan 0,019 dibawah 0,05. Dan secara simultan atau secara bersama-sama keempat variabel bebas yaitu *return on asset*, *earning per share*, *economic value added*, dan beta berpengaruh tidak signifikan terhadap pengembalian saham perusahaan manufaktur karena nilai signifikan dari uji hipotesis memiliki nilai 0,181 diatas 0,05 pada perusahaan makanan dan minuman yang terdaftar pada Bursa Efek Indonesia tahun 2011-2015.

Kata Kunci : return on asset, earning per share, economic value added, beta, return saham