

ASTRAK

Dwi Syafira Ilma Zakiya Arifin (2020), pengaruh *Earning per share* (EPS), *Return On Assets* (ROA), *Return On Equity* (ROE), dan *Price Earning Ratio* (PER) terhadap *return* saham Perusahaan Sub Sektor *Property* dan *Real Estate* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2015-2019. Dibawah bimbingan Prasetyo Nugroho, S.Pi., M.M.

Seorang Investor saat akan melakukan investasi memiliki tujuan utama yaitu memperoleh *return* saham yang tinggi. Hal ini menuntun seorang investor untuk mampu melihat *return* saham sebagai parameter untuk menilai seberapa besar keuntungan suatu saham. Penelitian ini bertujuan untuk menilai seberapa besar *Earning per share* (EPS), *Return On Assets* (ROA), *Return On Equity* (ROE), dan *Price Earning Ratio* (PER) memiliki pengaruh terhadap *return* saham Perusahaan Sub Sektor *Property* dan *real estate* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2015-2019 secara parsial dan simultan.

Populasi dari penelitian ini adalah Perusahaan Sub Sektor *Property* dan *real estate* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2015-2019 dengan jumlah populasi 65 perusahaan. Sampel penelitian yang terdiri dari 24 perusahaan, dengan teknik pengambilan sampel menggunakan teknik *purpose sampling*. Data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data sekunder. Teknik analisis data yang digunakan adalah uji asumsi klasik, analisis regresi linier berganda dan uji hipotesis yang terdiri dari uji koefisien determinasi dan uji t dengan tingkat signifikansi sebesar 0,05.

Berdasarkan hasil penelitian menunjukkan bahwa *Earning per share* (EPS) berpengaruh negatif dan signifikan terhadap *return* saham dengan nilai sebesar $0,968 > 0,05$ dan koefisien regresi sebesar $-0,041$. *Return On Assets* (ROA) berpengaruh positif dan tidak signifikan terhadap *return* saham dengan nilai sebesar $0,987 > 0,05$ dan koefisien regresi sebesar $0,016$. *Return On Equity* (ROE) berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham dengan nilai sebesar $0,009 < 0,05$ dan koefisien regresi sebesar $2,650$ dan *Price Earning Ratio* (PER) berpengaruh negatif dan tidak signifikan terhadap *return* saham dengan nilai sebesar $0,869 > 0,05$ dan koefisien regresi sebesar $-0,177$.

Kata kunci : *Earning Per Share* (EPS), *Return On Assets* (ROA), *Return On Equity* (ROE), *Price Earning Ratio* (PER) dan *return* saham.

ABSTRACT

Dwi Syafira Ilma Zakiya Arifin (2020), *the influence of Earning per share (EPS), Return On Assets (ROA), Return On Equity (ROE), and Price Earning Ratio (PER) on stock returns of listed Property and Real Estate Sub Sector Companies on the Indonesia Stock Exchange for the period 2015-2019. Under the guidance of Prasetyo Nugroho, S.Pi., M.M.*

An investor, when making an investment, has the main objective of obtaining a high stock return. This leads an investor to be able to see stock returns as a parameter to assess how much profit a stock has. This study aims to assess how much Earning per share (EPS), Return On Assets (ROA), Return On Equity (ROE), and Price Earning Ratio (PER) have an influence on stock returns in the Property and Real Estate Sub Sector Companies listed in Indonesia Stock Exchange for the period 2015-2019 partially and simultaneously.

The population of this study is the property and real estate sub-sector companies listed on the Indonesia Stock Exchange for the period 2015-2019 with a population of 65 companies. The research sample consisted of 18 companies, with the sampling technique using purposive sampling technique. The data used in this research is secondary data. The data analysis technique used is the classical assumption test, multiple linear regression analysis and hypothesis testing consisting of the coefficient of determination test and t test with a significance level of 0.05.

The research results, it shows that EPS has a negative and significant effect on stock returns with a value of $0.968 > 0.05$ and a regression coefficient of -0.041 . Return on Assets (ROA) has a positive and insignificant effect on stock returns with a value of $0.987 > 0.05$ and a regression coefficient of 0.016 . Return on Equity (ROE) has a positive and significant effect on stock returns with a value of $0.009 < 0.05$ and a regression coefficient of 2.650 and Price Earning Ratio (PER) has a negative and insignificant effect on stock returns with a value of $0.869 > 0.05$ and regression coefficient of -0.177 .

Keywords: *Earning Per Share (EPS), Return On Assets (ROA), Return On Equity (ROE), Price Earning Ratio (PER) and stock returns.*