

INTISARI

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh *Return On Equity* (ROE), *Earning Per Share* (EPS), *Dividend Payout Ratio* (DPR) dan Suku Bunga terhadap *Return* saham perusahaan *real estate dan property* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2010-2013. Variabel independen dalam penelitian ini adalah *Return On Equity* (ROE), *Earning Per Share* (EPS), *Dividend Payout Ratio* (DPR) dan Suku Bunga, sedangkan dependennya adalah *Return* saham.

Teknik pengambilan sampel dalam penelitian ini menggunakan *purposive sampling*, sehingga jumlah sample yang digunakan dalam penelitian ini ada 65 perusahaan *real estate dan property* yang terdaftar di Busa Efek Indonesia. Data yang diperoleh dianalisis menggunakan Regresi Linier Berganda dengan *software* SPSS 16.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa secara persial *Return On Equity* (ROE) tidak memiliki pengaruh terhadap *return* saham. *Earning Per Share* (EPS) memiliki pengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham. *Dividend Payout Ratio* (DPR) tidak memiliki pengaruh yang signifikan terhadap *return* saham. Suku Bunga memiliki pengaruh negative dan signifikan terhadap *return* saham. Secara simultan *Return On Equity* (ROE), *Earning Per Share* (EPS), *Dividend Payout Ratio* (DPR) dan Suku Bunga Memiliki pengaruh terhadap *return* saham.

Kata kunci : *Return On Equity* (ROE), *Earning Per Share* (EPS), *Dividend Payout Ratio* (DPR), Suku Bunga dan *Return Saham*.

ABSTRACT

This study aimed to analyze the influence of Return On Equity (ROE), Earning Per Share (EPS), Dividend Payout Ratio (DPR) and BI Rate to Stock Return on real estate and property companies in Indonesia Stock Exchange period 2010-2013. Independent variables are Return On Equity (ROE), Earning Per Share (EPS), Dividend Payout Ratio (DPR) and BI Rate. Dependent variable is Stock Return.

The researcher used purposive sampling for this study. The samples of this study are 65 companies of real estate and property which listed on Indonesia Stock Exchange. The analyze of data used multiple linear regression with SPSS 16th.

The result of the partial test (t test) showed Return On Equity (ROE) does not have significant effect with stock return. Earning Per Share (EPS) have significant positive effect to stock return. Dividend Payout Ratio does not have significant effect to stock return. Interest rate have significant negative effect to stock return. Simultaneously Return On Equity (ROE), Earning Per Share (EPS), Dividend Payout Ratio (DPR) and BI Rate have significant effect to stock return.

Keywords : Return On Equity (ROE), Earning Per Share (EPS), Dividend Payout Ratio (DPR), Interest Rate dan Stock Return