

ABSTRAK

Sellyanti (1128020072) Pengaruh *Return on Asset* (ROA), *Net Profit Margin* (NPM), *Earning per Share* (EPS) dan *Price Earning Ratio* (PER) terhadap Return Saham Pada PT Aneka Tambang Tbk, tahun 2003-2014.

Penelitian ini dilakukan untuk menguji faktor-faktor yang mempengaruhi *return* saham perusahaan pada PT. Aneka Tambang Tbk tahun 2003-2014 dengan menggunakan variabel *Return on Asset* (ROA), *Net Profit Margin* (NPM), *Earning per Share* (EPS) dan *Price Earning Ratio* (PER).

Metode penelitian yang digunakan adalah metode deskriptif verikatif. Data yang digunakan adalah data sekunder yang diperoleh berdasarkan publikasi PT. Aneka Tambang Tbk (www.antam.com) dan www.idx.co.id. Teknik analisis yang digunakan adalah uji asumsi klasik, regresi berganda dan uji hipotesis dilakukan dengan menggunakan Uji-t dan Uji F dengan signifikansi (α) 5%. Penganalisaan data menggunakan *software* pengolahan data statistik yaitu IBM SPSS *Statistics Version 20*.

Hasil uji secara parsial menunjukkan bahwa variabel ROA, NPM dan PER tidak terdapat pengaruh signifikan terhadap *return* saham, sedangkan variabel EPS berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham. Secara simultan, hasil Uji F menunjukkan bahwa semua variabel independen terdapat pengaruh signifikan terhadap *return* saham secara bersama-sama. Dengan angka koefisien determinasi yang dihasilkan sebesar 75,4% yang menunjukkan bahwa kedua variabel independen berpengaruh sebesar 24,6% terhadap *return* saham.

Kata Kunci : *Return on Asset* (ROA), *Net Profit Margin* (NPM), *Earning per Share* (EPS), *Price Earning Ratio* (PER) dan *return* saham