

ABSTRAK

Selvy Setia Anggraeni (1178020225):” Analisis pengaruh *Debt to Equity Ratio* (DER), *Return On Asset* (ROA), dan *Earning Per Share* (EPS) Terhadap *Return Saham* pada Perusahaan yang Terdaftar di LQ45 pada Tahun 2015-2019”.

Return saham merupakan tingkat pengembalian yang diperoleh investor dari investasi pada saham. Semakin tinggi pengembalian yang diharapkan, maka tingkat risikonya pun semakin tinggi, sedangkan semakin rendah *return* saham, maka tingkat risikonya akan rendah. Maka dari itu, sebelum investor menginvestasikan modalnya, investor perlu mengetahui apa saja yang akan mempengaruhi tingkat pengembalian saham. Banyak hal yang mempengaruhi *return* saham baik dari harga saham maupun dari laba yang diperoleh oleh perusahaan. Alangkah lebih baik, seorang investor juga meneliti mengenai laporan keuangan perusahaan secara menyeluruh.

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui (1) pengaruh *Debt to Equity Ratio* terhadap *Return Saham*, (2) pengaruh *Return On Asset* terhadap *Return Saham*, (3) pengaruh *Earning Per Share* terhadap *Return Saham*, (4) pengaruh *Debt to Equity Ratio*, *Return On Asset* dan *Earning Per Share* terhadap *Return Saham* secara bersamaan.

Metode penelitian yang digunakan adalah asosiatif klausul dengan pendekatan kuantitatif. Populasi penelitian adalah perusahaan yang terdaftar di LQ45 tahun 2015-2019 dan yang menjadi sampel sebanyak 9 perusahaan. Teknik pengumpulan sampel dengan menggunakan teknik *purposive sampling*.

Hasil penelitian ini menggunakan α sebesar 0,05 atau 5%. Secara parsial *Debt to Equity Ratio* berpengaruh positif signifikan terhadap *Return* saham. *Return On Asset* berpengaruh positif signifikan terhadap *Return* saham. *Earning Per Share* berpengaruh positif signifikan terhadap *Return* saham. Secara simultan *Debt to Equity Ratio*, *Return On Asset*, *Earning Per Share* secara serempak berpengaruh signifikan terhadap *Return* saham. Koefisien determinasi dihasilkan sebesar 36,79% variabel dependen mampu mempengaruhi variabel independen, sisanya kemungkinan dipengaruhi oleh variabel lainnya yang tidak diteliti.

Kata Kunci : *Debt to Equity Ratio*, *Return On Asset*, *Earning Per Share*, *Return Saham*.