

Eka Nofiyati Ningsih, 09322084, **Pengaruh Firm Size, Return On Assets dan Return On Equity Terhadap Return Saham (Studi pada Perusahaan *Real Estate dan Property* yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) pada Tahun 2009-2011)**, Akuntansi, Fakultas Ekonomi, Universitas Muhammadiyah Gresik, Juli, 2013

Abstraksi

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh *Firm Size*, *Return on Asset* (ROA), dan *Return on Equity* (ROE) terhadap *return* saham perusahaan *Real Estate dan Property* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Hipotesis yang akan diuji dalam penelitian ini adalah terdapat pengaruh antara *Firm Size*, *Return on Asset* (ROA), dan *Return on Equity* (ROE) terhadap *return* saham perusahaan *Real Estate dan Property* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia.

Populasi yang digunakan dalam penelitian ini adalah perusahaan *Real Estate dan Property* yang telah *go public* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia sepanjang tahun 2009 hingga tahun 2011, yang berjumlah 43 Perusahaan. Dengan menggunakan pendekatan kriteria *purposive sampling* didapat sebanyak 35 perusahaan untuk dijadikan sampel penelitian. Penelitian ini menggunakan model analisis regresi linier berganda. Hipotesis dalam penelitian ini dibuktikan dengan menggunakan uji statistik. Uji F untuk pengujian secara simultan dan Uji t untuk pengujian secara parsial.

Berdasarkan hasil analisis yang dilakukan ditemukan bahwa variabel *Firm Size*, *Return on Asset* (ROA) dan *Return on Equity* (ROE) tidak berpengaruh terhadap *return* saham perusahaan *Real Estate dan Property* terdaftar di Bursa Efek Indonesia.

Kata Kunci: *Return Saham*, *Firm Size*, *Return on Asset* (ROA), dan *Return on Equity* (ROE).

Eka Nofiyati Ningsih, 09322084, **Effect of Firm Size, Return on Assets and Return on Equity Of Stock Return, (Studies in Real Estate and Property Companies Listed in Indonesia Stock Exchange (BEI) in the Years 2009-2011)**, Accounting, Faculty of Economics, University of Muhammadiyah Gresik, July, 2013

Abstraction

This study aimed to determine the effect of Firm Size, Return on Assets (ROA) and Return on Equity (ROE) on stock returns and Real Estate Property company listed in Indonesia Stock Exchange. Hypotheses to be tested in this study is there is influence between Firm Size, Return on Assets (ROA) and Return on Equity (ROE) on stock returns and Real Estate Property company listed in Indonesia Stock Exchange.

The population used in this study is a Real Estate and Property companies that have gone public are listed in the Indonesia Stock Exchange during the year 2009 to the year 2011, which amounted to 43 companies. By using purposive sampling approach obtained criteria of 35 companies to the research sample. This study uses multiple linear regression analysis model. Hypothesis is proven by using statistical tests. Test F for simultaneous testing and t test for partial testing.

According to analysis conducted found that the variable Firm Size, Return on Assets (ROA) and Return on Equity (ROE) has no effect on stock returns and Property Real Estate company in Indonesia Stock Exchange.

Keywords: Stock Return, Firm Size, Return on Assets (ROA) and Return on Equity (ROE).