

Irma Faridzatun Nisa, 11311041, **Analisis *Return On Equity*, *Debt To Equity Ratio*, *Earning Per Share* Terhadap *Return Saham* Di Sektor *Property* Dan *Real Estate* Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Periode 2011- 2013**, Manajemen, Fakultas Ekonomi, Universitas Muhammadiyah Gresik

Abstraksi

Penelitian ini bertujuan untuk untuk menguji pengaruh variabel, *Return On Equity (ROE)* , *Debt to Equity Ratio (DER)*, dan *Earning Per Share (EPS)* terhadap *Return Saham*. Penelitian Metodologi sebagai sampel yang digunakan sampel proporsive dengan kriteria sebagai berikut (1) Perusahaan *Property* dan *Real Estate* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia dengan pengamatan dari tahun 2011-2013 (2)Perusahaan *Property* dan *Real Estate* yang memiliki nilai *Return on Equity*, *Debt Equity Ratio*, dan *Earning Per Share* positif (3)Perusahaan *Property* dan *Real Estate* yang memiliki data variabel-variabel yang digunakan dalam penelitian ini. Sebanyak 28 sampel yang diperoleh dari 46 perusahaan selama periode pengamatan tiga tahun di sektor *Property* dan *Real Estate*. Jumlah sampel sebanyak 84 selama periode pengamatan tiga tahun.

Analisis data menggunakan uji regresi linier berganda dan uji hipotesis dilakukan dengan uji parsial t, uji simultan F dengan tingkat signifikansi 5%. Hasil uji parsial t menunjukkan bahwa *Return on Equity (ROE)* tidak mempunyai pengaruh terhadap return saham dimana tingkat signifikannya lebih besar dari alpha ($0,765 > 0,05$). *Debt Equity Ratio (DER)* tidak mempunyai pengaruh terhadap return saham dimana tingkat signifikannya lebih besar dari alpha ($0,052 > 0,05$). *Earning Per Share (EPS)* tidak mempunyai pengaruh terhadap return saham dimana tingkat signifikannya lebih besar dari alpha ($0,418 > 0,05$). Hasil uji F *Return on Equity (ROE)*, *Debt Equity Ratio (DER)*, *Earning Per Share (EPS)* tidak memiliki pengaruh yang signifikan terhadap return saham pada sektor *Property* dan *Real Estate* periode 2011-2013 dengan tingkat signifikansi lebih besar dari alpha ($0,261 > 0,05$).

Kata Kunci: *Return On Equity (ROE)*, *Debt to Equity Ratio (DER)*, dan *Earning Per Share (EPS)*, *Return Saham*.

Irma Faridzatun Nisa, 11311041, **Analysis Of Return On Equity, Debt To Equity Ratio, Earning Per Share In Stock Return Of Property And Real Estate Sector Listed In Indonesia Stock Exchange Period 2011- 2013**, Management, Faculty of Economics, University of Muhammadiyah Gresik, oktober, 2014

Abstract

This reserch aimed to examine the influence of variables, Return On Equity (ROE), Debt to Equity Ratio (DER), and Earning Per Share (EPS) of the Stock Return. Research Methodology as samples used propoitive sampling with the following criteria (1) Property and Real Estate Company listed on the Indonesia Stock Exchange with observations from 2011-2013 (2) Property and Real Estate Company which has a value of Return on Equity, Debt Equity ratio, and Earning Per Share positively (3) Property and Real Estate Company owns the data variables used in this study. A total of 28 samples were obtained from 46 companies during the observation period of three years in the Property and Real Estate sectors. The total sample of 84 during the observation period of three years.

Analysis of data using multiple linear regression and hypothesis testing is done with partial t test, F simultaneous test with a significance level of 5%. The test results show that the partial t Return on Equity (ROE) has no effect on stock returns where greater significance level of alpha ($0.765 > 0.05$). Debt to Equity Ratio (DER) has no effect on stock returns where greater significance level of alpha ($0.052 > 0.05$). Earning Per Share (EPS) has no effect on stock returns where greater significance level of alpha ($0.418 > 0.05$). F test showed that the variables Return on Equity (ROE), Debt Equity Ratio (DER), Earning Per Share (EPS) has no significant effect on stock returns in the Property and Real Estate sector of 2011-2013 with a significance level greater than alpha ($0.261 > 0.05$).

Key Words: Return On Equity (ROE), Debt to Equity Ratio (DER), and Earning Per Share (EPS), Stock Return.