

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh fundamental terhadap *return* saham. faktor fundamental diwakili oleh *Return on Asset*, *Return on Equity*, *Earning Per Share*, *Debt to Equity Ratio*. Yang menjadi obyek didalam penelitian ini adalah perusahaan yang termasuk didalam Perusahaan Sektor industri Dasar dan Kimia yang terdaftar di BEI periode 2011-2013, sehingga tujuan lain dari penelitian ini adalah untuk mengetahui apakah terdapat perbedaan pengaruh *Return on Asset*, *Return On Equity*, *Earning per Share*, dan *Debt to Equity Ratio* terhadap *return* saham pada perusahaan sektor industri Dasar dan Kimia.

Untuk menguji hipotesis dalam penelitian ini, digunakan Metode Regresi Linier Berganda, Uji Normalitas, Uji Multikolinearitas, Uji Autokorelasi, Uji Heteroskedastisitas. Untuk menguji apakah ada pengaruh secara parsial dan secara simultan suatu model dilakukan pengukuran Uji Signifikansi-t, dan Uji Signifikansi- F. Untuk mengetahui apakah terdapat perbedaan pengaruh faktor fundamental terhadap *return* saham antara sektor industri dasar dan kimia yang terdaftar di BEI periode 2011-2013.

Penelitian ini menyimpulkan bahwa secara simultan (bersama-sama), *Return on asset*, *Return on Equity*, *Earning per Share*, dan *Debt to equity Ratio* tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham pada perusahaan sektor industri dasar dan kimia. Sedangkan pada perusahaan sektor industri dasar dan kimia variabel independen tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham.

Kata Kunci: Return on Asset (ROA), Return on Equity (ROE), Earning per share (EPS), Debt to Equity Ratio, dan Return Saham.