

PENGARUH *RETURN ON EQUITY* (ROE), *DEBT TO EQUITY RATIO* (DER) DAN *EARNING PER SHARE* (EPS) TERHADAP *RETURN SAHAM* (Studi Pada Perusahaan Sektor Pertambangan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2014-2018)

RINGKASAN

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh *Return On Equity* (ROE), *Debt to Equity Ratio* (DER) dan *Earning Per Share* (EPS) terhadap *return* saham pada perusahaan sektor pertambangan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Jenis penelitian yang digunakan adalah eksplanatori. Populasi dalam penelitian ini adalah seluruh perusahaan pertambangan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2014-2018 yang terdiri dari 49 perusahaan. Teknik pemilihan sampel menggunakan teknik *purposive sampling*. Sampel yang diperoleh adalah 7 perusahaan. Unit analisis yang digunakan adalah laporan keuangan yang telah diaudit. Teknik analisis data yang digunakan dalam penelitian ini adalah uji statistik deskriptif, uji asumsi klasik, analisis regresi linear berganda data panel, dan uji hipotesis dengan menggunakan uji statistik f dan uji statistik t. Taraf signifikansi pada penelitian ini sebesar 5 persen dengan menggunakan program *E-views 10*. Hasil penelitian menunjukkan bahwa secara parsial ROE, DER dan EPS berpengaruh terhadap *return* saham. Secara simultan ROE, DER dan EPS berpengaruh terhadap *return* saham.

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

THE INFLUENCE OF RETURN ON EQUITY (ROE), DEBT TO EQUITY RATIO (DER) AND EARNING PER SHARE (EPS) TO STOCK RETURN

(Study on Mining Companies Sector Listed on Indonesia Stock Exchange Period 2014-2018)

SUMMARY

This research aims to determine the influence of Return on Equity (ROE), Debt to Equity Ratio (DER) and Earning per Share (EPS) on stock return in mining companies sector listed on the Indonesia Stock Exchange. Type of the research is explanatory. The population of the research are 49 mining companies listed on the Indonesia Stock Exchange in period 2014-2018. The sample selection technique using purposive sampling technique. Sample obtained are 7 companies. The unit of analysis in this research were financial report have been audited. The data analysis techniques used in this research were descriptive assumption test, classical assumption test, panel data multiple linear regression analysis, and hypothesis test using f statistic test and t statistic test. The significance level in this research was 5 percent by using the program E-views 10. The result shows that partially ROE, DER and EPS effect to stock return. Simultaneously ROE, DER and EPS effect to stock return.

Keywords : Debt to Equity Ratio (DER), Earning Per Share (EPS), Return On Equity (ROE), stock return.