

ABSTRAKSI

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis seberapa besar pengaruh Return On Assets, Return On Equity, Earning Per Share dan Kurs Valuta Asing secara simultan dan parsial terhadap return saham perusahaan otomotif yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia tahun 2010-2014. Pupulasi penelitian ini adalah semua perusahaan Otomotif yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia tahun 2010-2014. Sampel penelitian ini menggunakan *purposive sampling*. Sampel dalam penelitian ini sebanyak 85 perusahaan otomotif yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Jenis data yang digunakan adalah data sekunder yang berasal dari *Indonesia Stock Exchange (IDX)*. Teknik analisis menggunakan analisis regresi linier berganda.

Hasil dengan menggunakan uji F menunjukkan bahwa kinerja perusahaan yang diukur dengan ROA, ROE, EPS dan KVA mempunyai pengaruh signifikan terhadap *return* saham. Secara parsial dengan uji t disimpulkan bahwa secara parsial, ROA, berpengaruh negatif dan ROE berpengaruh positif terhadap *return* saham. Sedangkan, EPS dan KVA tidak berpengaruh terhadap *return* saham.

Kata kunci: ROA, ROE, EPS, KVA, *return* saham

ABSTRACT

This study aims to analyze how much influence the Return on Assets, Return on Equity, Earning Per Share and Foreign Exchange Rates simultaneously and partially to the company's stock return Otomotif listed on the Indonesia Stock Exchange Year 2010-2014. The study population was all Otomotive companies listed in Indonesia Stock Exchange in 2010-2014. The study sample using purposive sampling method. The samples in this study were 17 Otomotive companies listed in Indonesia Stock Exchange. The type of data used are secondary data derived from Indonesia Stock Exchange (IDX). Engineering analysis using multiple linear regression analysis.

Using the F test results show that the performance of the company as measured by ROA, ROE, EPS and KVA has significant influence on stock return. Partially by t test concluded that in partial ROA have negative influence on stock return and ROE have positive influence on stock return. They are EPS and KVA doesn't have influence on stock return.

Key words: ROA, ROE, EPS, KVA, stock return