

ABSTRAK

Silvia Khoirunnisa. 1420210074.

Pengaruh *Return On Assets (ROA)*, *Net Profit Margin (NPM)*, dan *Earning Per Share (EPS)* Terhadap *Return Saham* (Studi Kasus pada Perusahaan Rokok yang Terdaftar di BEI tahun 2015-2017)

Return saham adalah bentuk kepercayaan publik terhadap kinerja perusahaan. Bagi investor keputusan investasi dalam bentuk saham merupakan keputusan yang diambil untuk mengalokasikan dana yang dimilikinya untuk mendapatkan keuntungan di masa yang akan datang. Penelitian ini bertujuan untuk menguji pengaruh karakteristik perusahaan yang diprosikan dengan *return on assets*, *net profit margin*, dan *earning per share* terhadap *return* saham perusahaan rokok yang *listing* di BEI.

Penelitian ini menggunakan analisis dengan analisis rasio keuangan dengan jenis penelitian korelasional. Sampel yang dapat diteliti dalam sektor industri rokok adalah 4 perusahaan dengan populasi yang berjumlah 48. Jenis sumber data adalah data sekunder, yang diperoleh secara tidak langsung dengan metode pengumpulan data menggunakan dokumentasi. Metode analisis yang digunakan adalah data panel yang meliputi data *cross section* dan *time series*. Untuk mengestimasi model digunakan model *Random Effect* dengan metode analisis data yang digunakan adalah uji asumsi klasik, regresi linear berganda, koefisien determinasi, signifikansi parameter individual, dan signifikansi simultan, dengan menggunakan aplikasi SPSS.

Hasil analisis penelitian menunjukkan bahwa secara parsial ROA dan NPM tidak memiliki pengaruh terhadap *return* saham. EPS berpengaruh terhadap *return* saham. secara simultan hasil analisis penelitian menunjukkan bahwa terdapat pengaruh antara variable ROA, NPM, dan EPS terhadap *return* saham perusahaan rokok yang terdaftar di BEI.

Kata Kunci : ROA, NPM, EPS, Return Saham