

ABSTRAK

PENGARUH NET PROFIT MARGIN (NPM), PRICE EARNING RATIO (PER) DAN EARNING PER SHARE (EPS) TERHADAP RETURN SAHAM PADA PERUSAHAAN YANG TERDAFTAR DI LQ45

Oleh :

NUR AL BAYYINAH
NIM.11171201549

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh *Net Profit Margin* (NPM), *Price Earning Ratio* (PER) dan *Earning Per Share* (EPS) terhadap *Return Saham* pada perusahaan yang terdaftar di LQ45. Data dalam penelitian ini diperoleh dari publikasi Indonesia Capital Market Directory 2011-2017. Jumlah sampel sebanyak 18 Perusahaan dan analisis yang digunakan adalah analisis regresi data panel dan alat bantu aplikasi Eviews versi 10.0. Hasil penelitian menunjukkan bahwa variabel *Net Profit Margin* (NPM) tidak berpengaruh signifikan terhadap *Return Saham* dengan tingkat signifikan sebesar $0.4639 > 0.05$. *Price Earning Ratio* (PER) berpengaruh positif dan signifikan terhadap *Return Saham* dengan tingkat signifikan sebesar $0.0003 < 0.05$. sedangkan *Earning Per Share* (EPS) juga berpengaruh positif dan signifikan terhadap *Return Saham* dengan tingkat signifikan sebesar $0.0000 < 0.05$. Hasil pengujian secara simultan diperoleh $F_{hitung} > F_{tabel} = 8.471520 > 2.68$ berarti Hipotesis secara simultan antara *Net Profit Margin* (NPM), *Price Earning Ratio* (PER) dan *Earning Per Share* (EPS) secara bersama-sama berpengaruh terhadap *Return Saham*. Dari hasil penelitian ini juga diperoleh koefisien determinasi (R^2) dengan nilai 0.218328 atau 21.83% yang berarti bahwa *Return Saham* dapat dipengaruhi oleh *Net Profit Margin* (NPM), *Price Earning Ratio* (PER) dan *Earning Per Share* (EPS). Sedangkan 78.17% sisanya merupakan varian yang tidak dijelaskan dalam penelitian ini.

Kata kunci: *Net Profit Margin (NPM), Price Earning Ratio (PER), Earning Per Share (EPS), Return Saham*