

## ABSTRACT

This study aims to determine how the effect of return on assets (*ROA*), Return on Equity (*ROE*), Earning Per Share (*EPS*) and Net Profit Margin (*NPM*) on stock returns of Property and Real Estate Companies on the Indonesia stock exchange. The data used in this study comes from ICMD and annual financial statements in period 2009-2013. The total sample of 25 companies that were taken by purposive sampling method, sample selection criteria are specified. To describe the relationship between the variables and the other variables as a whole, the analytical techniques used in this study is a multiple linear regression analysis. The results of this study indicate that during the 2009-2013 period *ROA* and *EPS* have a significant influence on Stock Return. While *ROE* and *NPM* does not have a significant effect on stock returns Property and Real Estate sector in the Indonesian Stock Exchange.

Keywords : *Return On Asset, Return On Equity, Earning Per Share, Net Profit Margin, Stock returns.*

## ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui bagaimana pengaruh Return On Asset (ROA), Return On Equity (ROE), Earning Per Share (EPS), dan Net Profit Margin (NPM) terhadap Return Saham perusahaan sektor Properti dan Real Estate di Bursa Efek Indonesia. Data yang digunakan dalam penelitian ini bersumber dari ICMD dan laporan keuangan tahunan emiten periode 2009-2013. Jumlah sampel sebanyak 25 perusahaan yang diambil dengan metode purposive sampling, yaitu pemilihan sampel dengan kriteria tertentu. Untuk mengetahui gambaran hubungan antara variabel satu dengan variabel yang lain secara menyeluruh, teknik analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah analisis regresi linear berganda. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa selama periode 2009-2013 variabel ROA dan EPS memiliki pengaruh signifikan terhadap Return Saham. Sedangkan variabel ROE dan NPM tidak memiliki pengaruh signifikan terhadap return saham perusahaan sektor Properti dan Real Estate di Bursa Efek Indonesia (BEI).

Kata Kunci : *Return On Asset, Return On Equity, Earning Per Share, Net Profit Margin, Return Saham.*