

ABSTRAKSI

Return merupakan hasil yang diperoleh dari suatu investasi. Return yang besar dengan resiko yang kecil pasti menjadi harapan para investor. Tapi pada kenyataannya para investor masih banyak menemui kesulitan dalam menentukan keputusan investasinya. Investor harus mempunyai banyak hal pertimbangan dalam menentukan investasi yang tepat. Analisa yang mempengaruhi return saham, tentu sangat diperlukan sebelum menentukan investasi. Banyak faktor yang mempengaruhi return saham, diantaranya adalah factor fundamental, yaitu faktor yang berhubungan dengan perusahaan itu sendiri. **“Pengaruh Faktor Fundamental Terhadap *Return Saham* (Studi Empiris Pada Perusahaan Manufaktur di Bursa Efek Indonesia)”**. Berdasarkan uraian diatas, maka judul penelitian ini adalah

Populasi dalam penelitian ini adalah perusahaan manufaktur yang terdaftar di BEI tahun 2005-2007 yang berjumlah 152 perusahaan. Teknik pengambilan sampel adalah purposive sampling sedangkan kriterianya adalah perusahaan manufaktur yang terdapat di BEI yang tidak melaporkan laporan keuangan selama 3 tahun berturut-turut sebanyak 12 perusahaan, perusahaan tersebut selama 3 tahun berturut-turut tidak menghasilkan laba sebanyak 60 perusahaan. Maka, sampel perusahaan menjadi 80 perusahaan. Jenis data yang digunakan adalah data sekunder, yaitu ROA, PER, TATO, DER dan Return. Metode pengumpulan data adalah dokumentasi. Alat analisis adalah regresi berganda.

Hasil penelitian ROA berpengaruh positif signifikan terhadap *return* saham, PER berpengaruh negatif tidak signifikan terhadap *return* saham, TATO berpengaruh positif tidak signifikan terhadap *return* saham, DER berpengaruh positif tidak signifikan terhadap *return* saham.

Kata Kunci : ROA, PER, TATO, DER, Return Saham