

ABSTRAK

Earnings Per Share (EPS) merupakan laba bersih per lembar saham yang dibagikan kepada investor atas hasil dari suatu investasi mereka. Tinggi rendahnya EPS akan menentukan tingkat *Return* yang diperoleh. Perusahaan yang memiliki EVA tinggi cenderung dapat lebih menarik investor untuk berinvestasi di perusahaan tersebut, karena semakin tinggi nilai EVA maka semakin tinggi pula nilai perusahaan. Kenaikan suku bunga akan berakibat terhadap menurunnya return saham begitu juga sebaliknya. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui: 1. Pengaruh *Earnings Per Share* (EPS) terhadap *Return Saham* Perusahaan Sektor Industri Barang Konsumsi yang terdaftar di BEI periode 2013-2017. 2. Pengaruh *Economic Value Added* (EVA) terhadap *Return* saham Perusahaan Sektor Industri Barang Konsumsi yang terdaftar di BEI periode 2013-2017. 3. Pengaruh *Economic Value Added* (EVA) terhadap *Return* saham Perusahaan Sektor Industri Barang Konsumsi yang terdaftar di BEI periode 2013-2017. Populasi penelitian ini adalah Perusahaan Sektor Industri Barang Konsumsi yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia pada tahun 2013-2017 sebanyak 43 perusahaan. Sampel penelitian sebanyak 17 perusahaan selama 5 tahun sehingga jumlah data yang diteliti 85 data sebelum outlier. Teknik pengumpulan data yang digunakan adalah studi dokumentasi dan penelitian kepustakaan. Teknik analisis data yang digunakan statistik deskriptif, uji asumsi klasik dan analisis regresi linier berganda. Hasil penelitian menunjukkan: EPS berpengaruh terhadap *Return* Saham. Hal ini ditunjukkan dengan signifikansi 0,036 atau kurang dari 0,05. EVA tidak berpengaruh terhadap *Return* Saham. Hal ini ditunjukkan dengan signifikansi 0,170 atau lebih dari 0,05. Tingkat Suku Bunga berpengaruh terhadap *Return* Saham. Hal ini ditunjukkan dengan signifikansi 0,039 atau kurang dari 0,05.

Kata Kunci: *Return* Saham, *Earnings Per Share* (EPS), *Economic Value Added* (EVA), Tingkat Suku Bunga

ABSTRACT

Earnings Per Share (EPS) is the net income per share that is shared with investors on the results of an investment. High and low EPS will determine the level of Return obtained. Companies that have high EVA tend to be more attractive to investors to invest in the company, because the higher the value of EVA, the higher the value of the company. an increase in interest rates will result in a decline in stock returns and vice versa. The aim of this study is to determine: 1. Effect of Earnings Per Share toward Return Stocks at the Consumption Goods Industrial Sector Companies listed in the Stock Exchange period 2013-2017. 2. Effect of Economic Value Added toward Return Stock at the Consumption Goods Industrial Sector Companies listed in the Stock Exchange period 2013-2017. 3. Effect of BI Rate toward Return stock at the Consumption Goods Industrial Sector Companies listed in the Stock Exchange period 2013-2017. The population of this research is the the Consumption Goods Industrial Sector Company as listed in the Indonesia Stock Exchange in the year 2013-2017 as many as 43 companies. The research sample has 17 companies for 5 years so the amount of data that examined 85 data before outlier. The data collection technique used is the study of documentation and literature research. Data analysis used is descriptive statistics, classical assumption test and multiple linear regression analysis. The results showed: EPS does effect the Stock Return. This is indicated by significant as much as 0,036 smaller than 0.05. EVA has no effect on Stock Return. This is indicated by significant as much as 0,170 bigger than 0.05. BI Rate does effect the Stock Return. This is indicated by significant as much as 0,039 smaller than 0.05

Keywords: Return On Stocks, Earnings Per Share (EPS), Economic Value Added (EVA), BI Rate