ABSTRAK

Penelitian ini dilakukan pada Perusahaan Sector Perbankan Tbk sebagai salah satu perusahaan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Tujuan penelitian ini adalah untuk mengetahui pengaruh *return on asset* dan *capital adequacy ratio* terhadap return saham Perusahaan Sector Perbankan Tbk baik secara parsial maupun simultan.

Metode yang digunakan dalam penelitian ini adalah metode deskriptif verifikatif. Sampel yang digunakan dalam penelitian menggunakan metode *purposive sampling* yaitu laporan keuangan tahunan Perusahaan Sector Perbankan Tbk tahun 2004-2010 sebanyak 56 sampel menggunakan analisis Regresi Linier Berganda. Pengujian hipotesis dalam penelitian ini menggunakan statistik uji F dua pihak dan statistik t uji dua pihak dengan $\alpha = 0,05$. Proses analisis statistik tersebut menggunakan program *SPSS 17.0 for Windows.*

Hasil penelitian ini menunjukan bahwa variabel *return on asset* terhadap *return saham* memiliki pengaruh yang kuat dengan arah positif dengan nilai koefisien determinen sebesar 10,3%, sedangkan variabel *capital adequacy ratio* terhadap return saham memiliki pengaruh yang sangat rendah dengan arah positif dengan nilai koefisien determinen sebesar 13,1%. Kesimpulan dari analisis statitistik tersebut adalah *return on asset* dan *capital adequacy ratio* berpengaruh terhadap return saham secara simultan. Dan *capital adequacy ratio* tidak berpengaruh signifikan terhadap return saham secara parsial, tetapi *return on asset* pada Perusahaan Sektor Perbankan Yang Terdaftar di BEI Tbk. Berpengaruh positif terhadap return saham.

Kata kunci: *return on asset, capital adequacy ratio,* return saham