## *ABSTRACT*

*Getting the return (advantage) is main purpose from commerce of activity investors in capital market. The objectives of this research to analyze the influence of Price Earning Ratio (PER) (X1) and Return On Assets (ROA) (X2) on the Stock Return (Y) of the banking sector in Indonesia Stock Exchange in the year 2006-2010.*

*The method used in this research is verifikative descriptive method with qualitative and quantitative approaches. The sample used method purposive sampling. The research sample consisted of 40 financial statement period 2006-2010. To know Price Earning Ratio (PER) (X1) and Return On Assets (ROA) (X2) impact on the Stock Return (Y) used correlation, and to know how big contribution of variable used determine coefficients formula. Testing the hypothesis in this study using the two tiled t statistic test $\alpha = 0.05$. Obtaining the results of the analysis was processed using SPSS 18.0 for windows.*

*The results of studies using multiple linear regression equation model. The partial results of the study indicate that the variable ratio of price earnings ratio as a significant positive influence. Return On Assets Return on Assets (ROA are not significant positive effect on stock returns of the banking sector in Indonesia Stock Exchange in the periode of 2006-2010. Simultaneously, all independent variables have significant influence to stock return. The significance rate from Sig Value shows < 0.05 point.*



***Keyword: Price Earning Ratio (PER), Return On Asset (ROA), and Stock Return***

# ABSTRAK

Memperoleh *return* (keuntungan) merupakan tujuan utama dari aktivitas perdagangan para investor di pasar modal. Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh Rasio Harga Laba (PER) ($X_1$) dan Rasio Pengembalian Aktiva (ROA) ($X_2$) terhadap Return Saham (Y) sektor perbankan di Bursa Efek Indonesia periode 2006-2010.

Metode yang digunakan dalam penelitian ini adalah metode deskriptif verifikatif dengan pendekatan kualitatif dan pendekatan kuantitatif. Pengambilan sampel dilakukan dengan metode *purposive sampling.* Sampel penelitian ini terdiri dari 40 laporan keuangan periode 2006-2010. Untuk mengetahui Rasio Harga Laba ($X_1$) dan Rasio Pengembalian Aktiva ($X_2$) berdampak terhadap Tingkat Pengembalian Saham (Y) digunakan korelasi, dan untuk mengetahui seberapa besar kontribusi variabel digunakan rumus koefisien determinasi. Pengujian hipotesis dalam penelitian ini menggunakan statistik uji *t* dua pihak dengan $\alpha = 0.05$. Perolehan hasil analisis tersebut diolah menggunakan program *SPSS 18.0 for windows.*

Berdasarkan hasil penelitian menggunakan model persamaan regresi linier berganda. Secara parsial menunjukkan bahwa variabel Rasio Harga Laba *berpengaruh* signifikan sementara Rasio Pengembalian Aktiva (ROA) *berpengaruh tidak signifikan* terhadap return saham sektor perbankan di Bursa Efek Indonesia periode 2006-2010. Secara simultan menunjukkan bahwa variabel independen *berpengaruh signifikan* terhadap return saham. Yang dimana tingkat signifikansi dilihat dari nilai sig. yang menunjukkan angka < 0,05.



**Kata Kunci : Rasio Harga Laba, Rasio Pengembalian Aktiva, dan Tingkat Pengembalian Saham**