ABSTRAK

Novilia Lestari, ” Pengaruh Profitabilitas dan Dividen Tunai terhadap *Return* Saham pada PT. Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk” , dibawah bimbingan: Prof. Dr. Hj. Ria Ratna Ariawati, SE., MS., Ak.

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh Profitabilitas (ROE) dan Dividen Tunai terhadap Return Saham pada PT.BNI (Persero) Tbk, periode 2003 - 2010. Profitabilitas (ROE) yang tinggi dapat meningkatkan laba perusahaan, dan Dividen Tunai yang tinggi dapat meningkatkan kepercayaan investor dalam memasukkan dananya ke dalam perusahaan.

Metode penelitian yang digunakan adalah metode deskriptif dan verifikatif. Untuk mengetahui keterkaitan antara Profitabilitas (ROE) dan Dividen Tunai terhadap Return Saham, digunakan pengujian statistik sebagai berikut, analisis regresi linier berganda, koefisien korelasi *pearson*, koefisien determinasi,uji asumsi klasik dan uji hipotesis yang memakai aplikasi *SPSS 19.0 for windows*.

Hasil uji statistik menunjukkan adanya pengaruh sangat rendah antara Profitabilitas (ROE) dan Dividen Tunai terhadap Return Saham. Peningkatan Profitabilitas (ROE) dan Dividen Tunai akan diikuti dengan peningkatan Return Saham, begitupun sebaliknya, penurunan Profitabilitas (ROE) dan Dividen Tunai akan diikuti dengan penurunan Return Saham Kesimpulan dari analisis statistik tersebut adalah Profitabilitas (ROE) dan Dividen Tunai berpengaruh secara tidak signifikan terhadap Return Saham.

Kata kunci: Profitabilitas (ROE, Dividen Tunai , dan *Return* Saham.

ABSTRACT

Novilia Lestari, "The Influence Of Profitability and Cash Dividend To Stock Return At PT. Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk", under supervision: Prof. Dr. Hj. Ria Ratna Ariawati, SE., MS., Ak.

This researchs objective to analize the influence of Profitability (ROE) and Cash Dividend to Stock Return in PT.BNI (Persero) Tbk, period 2003-2010. Profitability (ROE) that high can increase profit companies, and Cah Dividend that high can increase trust investor inside input fund in companies.

The method used is descriptive and verification method. To determine the relation between Profitability (ROE) and Cash Dividend to Stock Return, used the following statistical test, fold linear regression analysis, Pearson correlation coefficient, coefficient determination, assumption classic testing and hypothesis testing using SPSS 19.0 for Windows applications.

Result of statistical testing show the influence of very low relation between Profitability (ROE) and Cah Dividend to Stock Return. Increase the Profitability (ROE) and Cash Dividend will increase Stock Return, like that also opposite, decrease Profitability (ROE) and Cash Dividend to Stock Return will decrease Stock Return. A conclusion from the analysis of these statistics is Profitability (ROE) and Cash Dividend impact according to not significant to Stock Return.

Keywords: Profitability (ROE), Cash Dividend, and Stock Return.