ABSTRAK

PENGARUH *RETURN ON INVESMENT* DAN *DIVIDEND YIELD* TERHADAP *RETURN* SAHAM PADA PERUSAHAAN MAKANAN DAN MINUMAN YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK INDONESIA PERIODE 2010-2014

Oleh :
Intan Siti Nur Hidayati
21210087

Fenomena yang terjadi pada penelitian ini adalah bahwa pada perusahaan makanan dan minuman dalam kurun waktu beberapa tahun tepatnya pada tahun 2010-2014 terjadi penurunan dalam return sahamnya padahal tingkat *return on invesment* dan *dividend yield* meningkat. Hal ini bertentangan dengan teori (Octora 2003 : 5) yang menyebutkan bahwa semakin tinggi pengembalian atas investasinya semakin baik keadaan perusahaan dalam pengembalian sahamnya. Serta teori dari (Gul, 2002 : 24) yang menyebutkan bahwa dengan semakin baiknya pengembalian saham didorong *dividend yield* yang baik dari tahun ke tahunnya makan perusahaan akan semakin maju dan sukses, karena dengan adanya kenaikan dan penurunan pada hasil pendapatan dividen yang diperoleh para pemegang saham itu akan menaikkan return sahamnya.

Penelitian ini bertujuan untuk menguji pengaruh *return on invesment* dan *dividend yield* terhadap *return* saham. Metode yang digunakan dalam penelitian ini menggunakan metode deskriptif verifikatif. Sampel yang digunakan dalam penelitian ini adalah 6 perusahaan makanan dan minuman yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (*cross section*) dan 5 tahun terakhir data laporan keuangan (*time series*) jadi jumlah data dalam penelitian ini sebanyak 30 data (*pool data*) dan metode analisis data digunakan untuk pengujian hipotesis adalah uji asumsi klasik, analisis linier berganda, analisis korelasi, koefisien determinasi dengan uji t dan uji f.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa secara parsial *return on invesment* memiliki pengaruh signifikan terhadap *return* saham dan *dividend yield* juga memiliki pengaruh yang signifikan terhadap *return* saham, sedangkan secara simultan juga *return on invesment* dan *dividend yield* memiliki pengaruh yang signifikan terhadap *return* saham

Kata kunci *: Return On Invesment*, *Dividend Yield* dan *Return* Saham