

ABSTRAK

FAKTOR-FAKTOR FUNDAMENTAL YANG MEMILIKI DAMPAK PADA RETURN SAHAM PADA PERUSAHAAN PERBANKAN

JANUAR 2019421057

Tesis. Magister Manajemen. 2021

Kata kunci : *Return Saham, NPM, EPS, PBV, DER,*

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisa pengaruh *Net Profit Margin* (NPM), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Earning Per Share* (EPS) dan *Price Book Value* (PBV) terhadap *Return Saham* Pada Perusahaan Perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia secara parsial dan secara simultan. Populasi penelitian ini adalah perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2015-2019, sampel penelitian ini sebanyak 37 perbankan yang ditentukan dengan menggunakan metode *purposive sampling*. Data dianalisis dengan analisis deskriptif dan analisis statistik menggunakan bantuan *software E-Views* versi 10. Adapun analisis statistik yang digunakan terdiri dari uji asumsi klasik, pemilihan model estimasi regresi data panel, analisis regresi data panel dan uji hipotesis.

Hasil penelitian ini menunjukkan secara parsial *Net Profit Margin* (NPM), dan *Earning Per Share* (EPS) tidak memiliki pengaruh terhadap *Return Saham* pada perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia tahun 2015-2019. *Debt to Equity ratio* (DER) dan *Price Book Value* (PBV) berpengaruh positif dan signifikan terhadap *Return Saham* pada perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia tahun 2015-2019. secara simultan *Net Profit Margin* (NPM), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Earning Per Share* (EPS) dan *Price book Value* (PBV) berpengaruh positif dan signifikan terhadap *Return Saham* pada perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia pada tahun 2015-2019. Kontribusi pengaruh *Net Profit Margin* (NPM), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Earning Per Share* (EPS) dan *Price book Value* (PBV) terhadap terhadap *Return Saham* sebesar 38,70% sedangkan sisanya 61,30% lagi dipengaruhi oleh variabel lain yang tidak dimasukkan dalam model pada penelitian ini.