

ABSTRAK

PENGARUH *RETURN ON ASSET*, *EARNING YIELD*, *DIVIDEND YIELD*, *DIVIDEND PAYOUT RATIO* TERHADAP *RETURN SAHAM*

AININ VIA ALIM

STIE PGRI DEWANTARA

JOMBANG

Penelitian ini bertujuan untuk menguji dan memperoleh bukti empiris mengenai pengaruh *Return On Asset*, *earning Yield*, *Dividend Yield*, *dividend Payout Ratio* terhadap *Return Saham* berupa *caital gain (loss)*. Dalam penelitian ini mengamati perusahaan jasa sub sektor kontruksi dan bangunan yang terdaftar di Bursa efek Indonesia pada periode 2015-2017.

Pada penelitian ini menggunakan metode *purposive sampling*, dan jumlah sampel perusahaan yang digunakan adalah sebanyak 33 sampel perusahaan jasa sub sector kontruksi dan bangunan yang terdaftar pada Bursa efek Indonesia pada periode 2015-2017. Teknik analisis statistik yang digunakan adalah uji regresi berganda dengan uji t sebagai uji hipotesis dengan tingkat signifikan $\alpha = 0,05$.

Hasil pengujian menunjukan hanya variabel *Return On Asset* yang secara signifikan mempunyai pengaruh terhadap *Return Saham* sedangkan *Earning Yield*, *Dividend Yield*, *dividend Payout Ratio* tidak mempunyai pengaruh signifikan terhadap *Return Saham*

Kata Kunci : *Return On Asset*, *Earning Yield*, *Dividend Yield*, *Dividend Payout Ratio*, dan *Return saham*

ABSTRACT

PENGARUH *RETURN ON ASSET*, *EARNING YIELD*, *DIVIDEND YIELD*, *DIVIDEND PAYOUT RATIO* TERHADAP RETURN SAHAM

AININ VIA ALIM

STIE PGRI DEWANTARA

JOMBANG

The purpose of this research is to test and get empirical evidence the effect of *Return On Asset*, *earning Yield*, *Dividend Yield*, *dividend Payout Ratio* on stock return with from capital gain (loss). This research observed construction and building service sector companies listed on Bursa Efek Indonesia (BEI) from 2015 until 2017.

Sampling technique for this research is on purposive sampling method. The number of sampling are 33 samples, which are listed in Bursa Efek Indonesia (BEI) in the periode 2015-2017. Statistical analysis technique used is multiple regression test with the t test as a test the hypothesis with level of sidnificance 5 percent ($\alpha = 0,05$).

The test result show only the Return On Asset variable has a significant effect on stock return while Earning Yield, Dividend Yield, Dividend Payout Ratio does not have a significant effect on stock return.

Key word: *Return On Asset*, *Earning Yield*, *Dividend Yield*, *Dividend Payout Ratio*, and stock return