

ABSTRAK

LULUK NUR FAIZAH. Pengaruh DER, EPS, ROA, dan Market Share Terhadap Return Saham pada Perusahaan Pertambangan yang Terdaftar di BEI Periode 2015-2019. di bawah bimbingan ERMALINA.

Tujuan penelitian ini adalah untuk menguji secara empiris pengaruh *Debt To Equity Ratio* (DER), *Earning Per Share* (EPS), *Return On Asset* (ROA) dan *MarketShare* Terhadap *Return* Saham pada Perusahaan Pertambangan yang Terdaftar di BEI Periode 2015-2019. Terdapat 11 perusahaan sampel dengan 55 data yang diteliti. Penelitian ini adalah penelitian kuantitatif, data yang diteliti berupa data sekunder yang diukur dengan skala rasio dalam pengolahan statistik. Teknik analisis yang digunakan adalah regresi linier berganda. Berdasarkan hasil analisis data dengan menggunakan uji parsial (uji t), *Debt To Equity Ratio* (DER) dan *Return On Asset* (ROA) tidak berpengaruh terhadap *return* saham, *Earning Per Share* (EPS) berpengaruh negatif dan signifikan terhadap *return* saham, serta *Market Share* berpengaruh positif dan signifikan terhadap *returnsaham*. Hasil analisis data dengan menggunakan uji simultan (uji F), *Debt To Equity Ratio* (DER), *Earning Per Share* (EPS), *Return On Asset* (ROA) dan *Market Share* memiliki pengaruh signifikan terhadap *return* saham. Nilai koefisien determinasi sebesar 0.234, hal ini berarti kemampuan variabel independen dalam menjelaskan variasi variabel dependen adalah sebesar 23.4%, sedangkan sisanya sebesar 76.6% dijelaskan oleh variabel independen lain di luar model penelitian ini.

Keywords: *Debt To Equity Ratio* (DER), *Earning Per Share* (EPS), *Return On Asset* (ROA), *Market Share* dan *Return* Saham