

## ABSTRAK

**Anita Hasan, NIM 931410249** 2014. “Pengaruh Indeks sektoral, *Price Earning Ratio* (PER), dan *Return On Equity* (ROE) terhadap *Return* saham pada PT Agro Lestari Tbk”. Skripsi, Program studi S-1 Manajemen Jurusan Manajemen, Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Negeri Gorontalo. Dibawah bimbingan **Bapak Raflin Hinelu, S.pd, M.Si** selaku pembimbing I dan **ibu Dewi Hamim, SE MM** selaku pembimbing II.

Penelitian ini didasarkan pada rumusan masalah yaitu apakah ada pengaruh indeks sektoral, *price earning ratio* (PER) dan *Return On Equity* (ROE) secara parsial dan simultan terhadap *Return* saham pada PT. Agro Lestari Tbk. Adapun yang menjadi tujuan utama adalah untuk mengetahui besarnya pengaruh Indeks sektoral, *Price Earning Ratio* dan *Return On Equity* terhadap *Return* saham pada PT Agro lestari Tbk. Metode yang digunakan dalam penelitian ini adalah metode kuantitatif. Metode ini digunakan untuk meramalkan pengaruh antara variabel yang satu dengan variabel yang lain yaitu variabel X1 (Indeks Sektoral), X2 (*Price Earning Ratio*), X3 (*Return On Equity*) merupakan variabel independen (bebas) dan variabel Y (*Return Saham*) merupakan variabel dependen (terikat). Instrumen yang digunakan adalah data sekunder serta untuk menganalisis data digunakan analisis regresi linear berganda, Uji F (Simultan), Uji t (Parsial) dan Asumsi Klasik. Berdasarkan hasil penelitian maka dapat diambil kesimpulan bahwa terdapat pengaruh Indeks sektoral, *Price Earning Ratio* (PER), dan *Return On Equity* (ROE) secara bersama-sama terhadap *Return* saham pada PT Agro Lestari Tbk, sedangkan secara parsial indeks sektoral berpengaruh negatif signifikan terhadap *return* saham, sedangkan *Price Earning Ratio* dan *Return On Equity* berpengaruh positif signifikan terhadap *return* saham. Dengan hasil uji diperoleh persamaan regresi berganda yaitu  $Y = -0.477 + 0.000X_1 + 0.160X_2 + 0.015X_3 + e$  Besarnya adjusted R<sup>2</sup> adalah 0.873 Hal ini berarti 87,3% variabel *return* saham dapat dijelaskan oleh variabel indeks sektoral, *Price Earning Ratio*, dan *Return On Equity*. Sedangkan sisanya 12.7% dijelaskan oleh variabel lain diluar variabel pengujian.

Kata kunci : indeks sektoral, *Price Earning Ratio* dan *Return On Equity*, *Return Saham*