

ABSTRAK

Penelitian ini dilakukan untuk menguji pengaruh *Loan To Deposit Ratio* (LDR), *Capital Adequacy Ratio* (CAR), *Operating Cash Flow* (OCF), dan *Return On Equity* (ROE) terhadap *return* saham perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) tahun 2011-2013.

Populasi dalam penelitian ini adalah seluruh perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia tahun 2011-2013. Teknik sampling yang digunakan adalah *purposive sampling*. Sampel penelitian ini sebanyak 28 perbankan yang memenuhi kriteria. Teknik analisis yang digunakan adalah regresi data panel dengan persamaan kuadrat terkecil dan uji hipotesis menggunakan t-statistik untuk menguji koefisien regresi parsial serta f-statistik untuk menguji keberartian pengaruh secara bersama-sama dengan level signifikansi 5%.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa *Loan To Deposit Ratio* (LDR), *Capital Adequacy Ratio* (CAR), *Operating Cash Flow* (OCF), dan *Return On Equity* (ROE) secara simultan mempunyai pengaruh signifikan terhadap *return* saham. Berdasarkan pengujian secara parsial *Loan To Deposit Ratio* tidak berpengaruh terhadap *return* saham, *Capital Adequacy Ratio* tidak berpengaruh terhadap *return* saham, *Operating Cash Flow* berpengaruh signifikan terhadap *return* saham, dan *Return On Equity* tidak berpengaruh terhadap *return* saham. Saran yang diberikan untuk penelitian selanjutnya adalah diharapkan dapat menambah variabel independen lainnya yang nantinya akan dapat mempengaruhi *return* saham.