

ABSTRAK

Sektor pertambangan di Indonesia merupakan sektor andalan yang menyediakan sumber energi, bahan baku industri dan sumber penerimaan negara, diantaranya dari devisa ekspor maupun pajak. Selain menjadi salah satu sektor penggerak roda perekonomian Indonesia, sektor pertambangan juga menjadi pemicu pertumbuhan sektor lainnya. Adanya hal positif dari sektor pertambangan ini berpengaruh terhadap kinerja emiten sektor pertambangan yang dapat mempengaruhi peluang emiten untuk meraih pendapatan operasional jauh lebih tinggi dan menarik investor untuk menanamkan modalnya di sektor pertambangan.

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh *Current Ratio*, *Return on Equity*, *Earning Per Share*, dan *Price Earning Ratio* terhadap *return* saham perusahaan sektor pertambangan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2007-2011 secara simultan maupun parsial. Metode yang digunakan dalam penelitian ini adalah metode regresi data panel dan menggunakan model *Random Effect*. Pengujian hipotesis menggunakan uji F, uji t, dan koefisien determinasi (R^2).

Hasil penelitian menunjukkan bahwa baik secara secara simultan dan parsial, seluruh variabel bebas tidak memiliki pengaruh signifikan terhadap *return* saham. Selain itu, diperoleh bahwa nilai koefisien determinasi (R^2) sebesar 0,041078 yang berarti bahwa variabel bebas mampu menjelaskan variabel terikat sebesar 4,1078% sedangkan sisanya 95,8922% dijelaskan oleh variabel lain di luar penelitian.

Keywords : *return* saham, *Current Ratio*, *Return on Equity*, *Earning Per Share*, *Price Earning Ratio*