

ABSTRAK

Penelitian ini dimaksudkan untuk menguji variabel-variabel yang diduga mempengaruhi *Return* saham. Variabel-variabel tersebut antara lain *Debt to Total Assets (DTA)*, *Earning Per Share (EPS)*, dan *Price to Book Value (PBV)*.

Teknik pengumpulan data melalui pengumpulan data dokumentasi. Metode penentuan sampel yang digunakan adalah *purposive sampling*. Sampel yang digunakan adalah 21 perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia selama periode 2008-2012. Teknik analisis yang digunakan adalah analisis regresi linear berganda dengan menggunakan program SPSS 20.

Hasil analisis dengan *F test* menunjukkan nilai *F* hitung = 4,661 dengan tingkat signifikansi 0,004 yang menunjukkan bahwa variabel independen berpengaruh secara simultan terhadap *Return* saham. Analisis dengan *t test* ingin mengetahui secara parsial variabel independen berpengaruh terhadap dependen menunjukkan hasil bahwa variabel *DTA* berpengaruh terhadap *return* saham dengan tingkat signifikansi 0,029 dan *EPS* berpengaruh terhadap *return* saham dengan tingkat signifikansi 0,005 dan. Sedangkan variabel *PBV* tidak berpengaruh terhadap *return* saham.

Kata Kunci: *Return* saham, *Debt to Total Assets (DTA)*, *Earning Per Share (EPS)*, *Price to Book Value (PBV)*.