

## **ABSTRACT**

*The investors who will invest by buying shares in the capital market will analyze the condition of an investment in a company that will generate profits. Gain (return) is the main purpose of trading activity in the stock market. This study aims to determine the effect of the debt to equity ratio, earnings per share and price earnings ratio to stock returns in the manufacturing companies listed on the Stock Exchange in 2013-2015. The sampling technique use purposive sampling. Data obtained sourced from financial statements published by the Indonesia Stock Exchange through the site [www.idx.co.id](http://www.idx.co.id). The dependent variable in this study is stock return and independent variables consisted of debt to equity ratio, earnings per share, and price earnings ratio. Methods of data analysis using multiple linear regression analysis using software Eviews 9. Data processing results showed that debt to equity ratio, earnings per share, and price earning ratio effect partially to the stock returns.*

*Keywords : stock return, debt to equity ratio, earning per share, price earning ratio*



UNIVERSITAS  
MERCU BUANA

## ABSTRAK

Para investor yang akan melakukan investasi dengan membeli saham di pasar modal akan terlebih dahulu menganalisis kondisi investasi di perusahaan yang akan menghasilkan keuntungan. Memperoleh keuntungan merupakan tujuan utama dari aktivitas trading di pasar modal. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh *debt to equity ratio*, *earning per share*, dan *price earning ratio* terhadap *return* saham pada perusahaan manufaktur yang listing di BEI tahun 2013-2015. Teknik pengambilan sampel menggunakan *purposive sampling*. Data yang diperoleh bersumber dari Laporan Keuangan yang dipublikasikan oleh Bursa Efek Indonesia melalui situs [www.idx.co.id](http://www.idx.co.id). Variabel dependen dalam penelitian ini adalah *return* saham dan variabel independen terdiri dari *debt to equity ratio*, *earning per share*, *price earning ratio*. Metode analisis data menggunakan analisis regresi linier berganda dengan menggunakan aplikasi *Eviews 9*. Hasil Pengolahan data menunjukkan bahwa *debt to equity ratio*, *earning per share*, dan *price earning ratio* masing-masing berpengaruh secara parsial terhadap *return* saham.

Kata Kunci : *return saham*, *debt to equity ratio*, *earning per share*, *price earning ratio*

UNIVERSITAS  
MERCU BUANA