

**PENGARUH *DEBT TO EQUITY RATIO*, *RETURN ON EQUITY*,
PRICE EARNING RATIO, DAN *PRICE TO BOOK VALUE*
TERHADAP *RETURN SAHAM PERUSAHAAN*
SEKTOR INDUSTRI DASAR & KIMIA
YANG TERDAFTAR DI BEI
PERIODE 2012-2016**

SKRIPSI

Program Studi Manajemen – Strata 1



OLEH:

NAMA : JUMANAH IZDIHAR

N I M : 041301503125254

**FAKULTAS EKONOMI
UNIVERSITAS SATYA NEGARA INDONESIA
JAKARTA
2017**

**PENGARUH *DEBT TO EQUITY RATIO*, *RETURN ON EQUITY*,
PRICE EARNING RATIO, DAN *PRICE TO BOOK VALUE*
TERHADAP *RETURN SAHAM PERUSAHAAN*
SEKTOR INDUSTRI DASAR & KIMIA
YANG TERDAFTAR DI BEI
PERIODE 2012-2016**

SKRIPSI

Diajukan Sebagai Salah Satu Syarat Untuk Memperoleh Gelar

SARJANA EKONOMI

Program Studi Manajemen – Strata 1



OLEH:

NAMA : JUMANAH IZDIHAR

N I M : 041301503125254

**FAKULTAS EKONOMI
UNIVERSITAS SATYA NEGARA INDONESIA
JAKARTA**

2017

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui faktor-faktor yang mempengaruhi *return* saham pada perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2012-2016. Variabel dependen yang digunakan dalam penelitian ini adalah *return* saham. Sedangkan variabel independennya adalah *Debt to Equity Ratio (DER)*, *Return on Equity (ROE)*, *Price Earning Ratio (PER)*, dan *Price to Book Value (PBV)*. Yang menjadi objek penelitian ini adalah perusahaan manufaktur sektor industri dasar dan kimia yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2012-2016. Teknik pengambilan sampel menggunakan metode *purposive sampling*, sehingga didapatkan total sampel 34 perusahaan industri dasar dan kimia. Metode analisis data yang digunakan dalam penelitian ini menggunakan Regresi Linier Berganda dengan SPSS Versi 22. Berdasarkan hasil uji hipotesis menunjukkan bahwa *Debt to Equity Ratio (DER)*, *Return on Equity (ROE)*, *Price Earning Ratio (PER)*, dan *Price to Book Value (PBV)* secara simultan berpengaruh terhadap *return* saham. Sedangkan secara Parsial *Debt to Equity Ratio (DER)* dan *Return on Equity (ROE)* berpengaruh signifikan, tetapi *Price Earning Ratio (PER)*, dan *Price to Book Value (PBV)* tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham.

Kata Kunci: *Debt to Equity Ratio (DER)*, *Return on Equity (ROE)*, *Price Earning Ratio (PER)*, *Price to Book Value (PBV)*, dan *Return Saham*

ABSTRACT

The purpose of this research is to determine the factors that affect stock returns on manufacturing companies listed on the Indonesia Stock Exchange Period 2012-2016. Dependent variable used in this research is stock return. The independent variables are Debt to Equity Ratio (DER), Return on Equity (ROE), Price Earning Ratio (PER), and Price to Book Value (PBV). The object of this research is manufacturing companies basic industry sectors and chemicals listed on Indonesia Stock Exchange Period 2012-2016. The sampling technique used purposive sampling method, so that the total samples of 34 basic industries and chemical companies were obtained. Data analysis method used in this study using Multiple Linear Regression with SPSS Version 22. Based on the result of hypothesis test show that Debt to Equity Ratio (DER), Return on Equity (ROE), Price Earning Ratio (PER), and Price to Book Value (PBV) simultaneously influence stock return. While the partial Debt to Equity Ratio (DER) and Return on Equity (ROE) has a significant effect, but Price Earning Ratio (PER), and Price to Book Value (PBV) have no significant effect on stock return.

Keywords: Debt to Equity Ratio (DER), Return on Equity (ROE), Price Earning Ratio (PER), Price to Book Value (PBV), and Stock Return