

ABSTRAK

Salah satu harapan investor dalam melakukan investasi dalam bentuk saham adalah untuk mendapatkan kembalian (*return*). Tujuan dari penelitian ini adalah menganalisis pengaruh variabel independen yaitu *return on asset*, *debt to equity ratio*, *price to book value*, *earning per share* dan nilai tukar secara sendiri – sendiri (parsial) terhadap *return* saham pada perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia

Sampel penelitian ini adalah dengan mengambil 113 perusahaan manufaktur di BEI dengan metode *purposive non random sampling*. Alat analisis yang digunakan uji regresi berganda yang sebelumnya dilakukan uji normalitas, uji penyimpangan asumsi klasik (multikolinearitas, heteroskedastisitas dan autokorelasi), uji hipotesis (t dan F) dan pengujian koefisien determinasi.

Hasil yang diperoleh adalah *return on asset*, *price book value*, *earning per share* memiliki pengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. *Debt to equity ratio* mempunyai pengaruh negatif tidak signifikan terhadap *return* saham perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Kurs Dollar terhadap Rupiah mempunyai pengaruh yang negatif dan signifikan terhadap *return* saham perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia.

Kata kunci : *return* saham, *return on asset*, *debt to equity ratio*, *price book value*, *earning per share* dan kurs Dollar terhadap Rupiah

