

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui factor-faktor yang mempengaruhi *Return Saham* khususnya *Holding Period Return (HPR)*. Variabel yang digunakan dalam penelitian ini adalah *Return on Assets (ROA)*, *Return on Equity (ROE)*, *Dividend Payout Ratio (DPR)*, *Earning per Share (EPS)*, *Price to Book Value (PBV)*, dan *Price Earning Ratio (PER)*.

Objek penelitian yang digunakan adalah saham yang terdaftar pada indeks IDX30 pada tahun 2017-2022. Penelitian ini menggunakan metode *purposive sampling*, yang mana sampel yang digunakan telah memenuhi kriteria untuk masuk selama 5 tahun berturut-turut berjumlah 16 perusahaan. Metode penelitian yang digunakan dalam penelitian ini adalah Analisis Regresi Linier Berganda Data Panel.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa variabel ROA, ROE, DPR dan EPS tidak berpengaruh terhadap *Return* saham. Sedangkan variabel DPR dan PBV berpengaruh negatif terhadap *Return Saham*. Lalu Variabel PER berpengaruh positif terhadap harga saham. Dan Variabel ROA, ROE, DPR, EPS, PBV, dan PER berpengaruh secara simultan terhadap *Return* saham sebesar 17,3%, dimana sisanya dipengaruhi oleh variabel lain yang tidak terdapat pada penelitian ini.

Kata Kunci : ROE, ROA, Payout Ratio, EPS, PBV, PER, *Return Saham*, *Holding Period Return*