

ABSTRAK

Tujuan dalam penelitian ini adalah untuk mengetahui pengaruh *Price Earning Ratio*, Risiko Keuangan dan Likuiditas Saham terhadap *return* saham. Metode penelitian menggunakan metode kualitatif dan kuantitatif. Pengumpulan data menggunakan data sekunder yang dipublikasikan oleh Bursa Efek Indonesia. Sampel dalam penelitian ini adalah sub sektor *Property and Real Estate* yang tercatat di BEI selama periode 2009 - 2012 dengan total sampel yang diperoleh dari 10 perusahaan selama 4 tahun periode penelitian adalah sebanyak 40 sampel data. Hasil dari penelitian menunjukkan *return* saham dipengaruhi oleh *Price Earning Ratio* dan *Trading Volume Activity*, tetapi tidak dengan *Debt To Equity Ratio*. Secara bersama-sama (simultan), *Price Earning Ratio*, *Debt To Equity Ratio* dan *Trading Volume Activity* berpengaruh terhadap *Return* saham.

Kata Kunci : Price Earning Ratio, Debt to Equity Ratio, Trading Volume Activity Transaksi dan *Return* saham

ABSTRACT

The aim of this research is to find out the influence of *price earning ratio*, financial risk and stock liquidity towards stock *return*. The research carried out by the qualitative and quantitative methods. The data gathered based on secondary data published by Indonesian Stock Exchange (BEI). The sample used in this research are of property sub-sector and real estate recorded in Indonesian Stock Exchange (BEI). During the period of 2009-2012, the samples obtained in 4 years period of research from 10 companies amounting to 40 data samples. The result gained from the research showing that stock *return* influence by the variabel of *Price Earning Ratio* and *Trading Volume Activity*, but not by *Debt To Equity Ratio*. In all together (simultaneously), the stock *return* influence by *Price Earning Ratio*, *Debt To Equity Ratio* and *Trading Volume Activity*.

Key Words: Price Earning Ratio, Debt to Equity Ratio, Trading Volume Activity and stock *return*