

### ***Abstrack***

*The aims of this study is to obtain empirical eviden about the effect of Price Earning Ratio (PER), Price to Book Value (PBV), and Debt to Equity Ratio (DER) on Stock Return. Independent variables used in this study are Price Earning Ratio (PER), Price to Book Value (PBV), and Debt to Equity Ratio (DER) and Dependent variable used in this study is Stock Return.*

*Study's sample was the manufacture companies listed in Indonesia Stock Exchange (IDX) in periode of 2010-2013. Data was collected by purposive sampling method. Total 19 companies were taken as study's. analysis of the data used SPSS 2.0 Software, with multiple linear regression analysis to examine the connecting between independent variables with the dependent variable. and hypothesis test using partial test (t test) to see the effect of independent variables on the dependent variable individually. Simultan test (F test) to see the effect of the independent variables simultaneously on the dependent variable, and the coefficient determination test to see how much the independent variables affect the dependent variable.*

*The result of this test show us that Price Earning Ratio (PER) has significance and positive effect on Stock Return, Price to Book Value (PBV) has not significance and negative effect on Stock Return, and Debt to Equity Ratio (DER) has not significance but positive effect on Stock Return. And simultaneously this three variables not effect on Stock Return. The coefficient determination indicates the percentage of 11,9%, which means 88,1% stock return variable influenced by other variables outside of this research.*

*Keywords: Return Saham, Price Earning Ratio (PER), Price to Book Value (PBV), dan Debt to Equity Ratio (DER)*

## Abstrak

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui pengaruh parsial dan simultan dari informasi keuangan yang meliputi *Price Earning Ratio* (PER), *Price to Book Value* (PBV), dan *Debt to Equity Ratio* (DER) terhadap *Return Saham*. Variabel-variabel independen dalam penelitian ini adalah *Price Earning Ratio* (PER), *Price to Book Value* (PBV), dan *Debt to Equity Ratio* (DER), sedangkan variabel dependen dalam penelitian ini adalah *Return Saham*.

Perusahaan yang menjadi sampel penelitian ini adalah perusahaan manufaktur dalam kategori *consumer goods industry, food and beverages, cosmetics and household goods* dan *pharmaceuticals* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) pada periode 2010-2013. Data yang dikumpulkan menggunakan metode purposive sampling. Total 19 perusahaan manufaktur ditentukan sebagai sampel dari penelitian ini. Analisis data yang dilakukan menggunakan aplikasi SPSS 20, dengan pengujian analisis regresi linear berganda untuk melihat hubungan antara variabel-variabel independen dengan variabel dependen, serta pengujian hipotesis sendiri menggunakan pengujian Parsial (t test) untuk melihat pengaruh variabel-variabel independen secara individual terhadap variabel dependen, pengujian Simultan (F test) untuk melihat pengaruh variabel-variabel independen secara bersama-sama terhadap variabel dependen, dan pengujian koefisien determinasi untuk melihat seberapa besar variabel-variabel independen mempengaruhi variabel dependen.

Hasil pengujian menunjukkan bahwa variabel *Price Earning Ratio* (PER) berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham, variabel *Price to Book Value* (PBV) berpengaruh negatif tidak signifikan terhadap *return* saham, sedangkan variabel *Debt to Equity Ratio* (DER) berpengaruh positif namun tidak signifikan terhadap *return* saham. Dan secara bersama-sama ketiga variabel ini tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham. Hasil koefisien determinasi menunjukkan persentase sebesar 11,9% yang berarti 88,1% variabel *return* saham dipengaruhi oleh variabel-variabel lain diluar penelitian ini.

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