

ABSTRAK

Return saham menurut adalah merupakan hasil yang diperoleh dari investasi. *Return* dapat berupa *return* realisasi yang sudah terjadi atau *return* ekspektasi yang belum terjadi tetapi yang diharapkan akan terjadi di masa mendatang. Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis *Debt to Equity Ratio* (DER), *Price to Book Value* (PBV), dan *Return on Asset* (ROA) sebagai variabel independen serta *return* saham sebagai variabel dependen.

Penelitian ini tergolong ke dalam jenis penelitian deskriptif verifikatif bersifat kausal. Populasi dalam penelitian ini adalah industri dasar dan kimia yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) tahun 2010-2013 yang terdiri dari 51 perusahaan, dengan pemilihan sampel menggunakan *purposive sampling* didapatkan sampel sebanyak 38 perusahaan. Teknis analisis data yang digunakan dalam penelitian ini ialah analisis data regresi data panel. Data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data sekunder.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa Secara simultan DER, PBV dan ROA berpengaruh tidak signifikan terhadap *return* saham., dengan nilai *R-Square* sebesar 0.097681 atau 9,77%. dan sisanya dijelaskan oleh faktor lain yang tidak diikutsertakan dalam model. Hasil penelitian ini juga menunjukkan Secara parsial DER berpengaruh signifikan terhadap *return* saham, sedangkan PBV dan ROA tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham.

Kata Kunci: *Debt to Equity Ratio* ,*Price to Book Value*, dan *Return on Asset*, *Return Saham*.