

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan mengetahui pengaruh *net profit margin*, *debt to equity ratio*, dan *earning per share* terhadap *return* saham perusahaan manufaktur sub sektor otomotif yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia tahun 2011-2015.

Data yang digunakan dalam penelitian ini diperoleh dari Bursa Efek Indonesia tahun 2011-2015, serta laporan keuangan tahunan masing-masing perusahaan periode 2011-2015. Teknik sampling menggunakan *purposive sampling*. Sampel yang digunakan sebanyak 12 perusahaan. Metode analisis data menggunakan analisis regresi data panel untuk mengetahui pengaruh *net profit margin*, *debt to equity ratio*, dan *earning per share* terhadap *return* saham.

Hasil uji t menunjukkan net profit margin berpengaruh signifikan dan positif terhadap *return* saham perusahaan manufaktur sub sektor otomotif. Debt to equity ratio tidak berpengaruh signifikan dan negatif terhadap *return* saham perusahaan manufaktur sub sektor otomotif. Dan earning per share tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham perusahaan manufaktur sub sektor otomotif. Hasil penelitian ini diharapkan dapat menjadi pertimbangan bagi manajemen bank, investor dan masyarakat luas.

Kata kunci: *net profit margin*, *debt to equity ratio*, *earning per share*, *return* saham