

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menguji seberapa besar Pengaruh *Return On Equity*, *Debt To Equity Ratio*, *Price Earning Ratio*, Inflasi terhadap *Return Saham*. Data yang digunakan adalah data sekunder berupa laporan keuangan dan *annual report* tahun 2013 sampai 2017. Metode penentuan sampel menggunakan *purposive sampling*. Jumlah sampel adalah 28. Dan metode analisis yang digunakan adalah analisis regresi berganda menggunakan alat bantu *eviews*.

Hasil penelitian yang didapatkan berdasarkan Uji Parsial (Uji t) diperoleh secara parsial *Return On Equity* berpengaruh terhadap *return* saham. Sedangkan *Debt To Equity Ratio*, *Price Earning Ratio* dan inflasi tidak berpengaruh terhadap *return* saham. Berdasarkan Uji Simultan (Uji F) diperoleh *Return On Equity*, *Debt To Equity Ratio*, *Price Earning Ratio*, Inflasi secara bersama-sama berpengaruh terhadap *Return* saham. Adapun kontribusi *Return On Equity*, *Debt To Equity Ratio*, *Price Earning Ratio*, Inflasi terhadap *return* saham adalah sebesar 7,28% sisanya 92,72% dipengaruhi oleh variabel lain diluar penelitian ini. Hasil penelitian ini sejalan dengan penelitian Michael Aldo Carlo (2014), Budiyanto,dkk (2017), Soedjatmiko (2018), Suriyani, dkk (2018).

Kata kunci :*Return On Equity*, *Debt To Equity Ratio*, *Price Earning Ratio*,
Inflasi, *Return Saham*