

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh suku bunga, *loan to deposit ratio*, *non performing loan* dan *return on assets* terhadap *return* saham pada perusahaan perbankan di Bursa Efek Indonesia. Sampel pada penelitian ini diambil dengan metode *purposive sampling* pada perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Metode analisis data pada penelitian ini menggunakan analisis statistik deskriptif, uji asumsi klasik, uji Chow, uji hausman, regresi data panel, dan uji hipotesis. Hasil penelitian ini menyimpulkan bahwa Suku Bunga secara parsial berpengaruh negatif dan signifikan terhadap *Return Saham*, sedangkan *Loan To Deposit Ratio*, *Non Performing Loan*, *Return On Assets* secara parsial berpengaruh negatif dan tidak signifikan terhadap *Return Saham*. Berdasarkan hasil penelitian diatas maka penulis menyarankan bagi peneliti yang ingin meneliti dibidang yang sama dapat menambah periode penelitian dan menambah variabel lainnya yang memiliki kemungkinan berpengaruh terhadap *return* saham.

Kata Kunci: Suku Bunga, *Loan To Deposit Ratio*, *Non Performing Loan*, *Return On Assets*, Dan *Return Saham*.