

ABSTRAKSI

Penelitian ini dilakukan karena termotivasi adanya fenomena atau masalah *research gap* (hasil penelitian yang berbeda-beda) antara beberapa penelitian. Penelitian yang dilakukan oleh Julimurshida Ganto dkk. (2008) dengan hasil temuan bahwa *price book value* tidak berpengaruh signifikan terhadap return saham. Martha Suhardiyah (2003) dengan temuan bahwa *price earning ratio* berpengaruh negatif terhadap return saham, sedangkan penelitian Riki Martusa (2007) memperoleh bahwa *price earning ratio* tidak berpengaruh terhadap return saham. Dan Julimurshida Ganto dkk. (2008) menemukan bahwa *price earning ratio* berpengaruh positif terhadap return saham. Dan penelitian yang dilakukan Riki Martusa (2007) memperoleh bahwa *Dividend Yield* tidak berpengaruh terhadap Return Saham. Dari fenomena tersebut maka dilakukan penelitian yang bertujuan untuk menganalisis pengaruh *price book value*, *price earning ratio*, dan *dividend yield* terhadap *return* saham secara parsial di Bursa Efek Indonesia.

Sampel penelitian sebanyak 14 perusahaan manufaktur di BEI, dimana metode yang digunakan adalah *purposive sampling* yaitu suatu metode pengambilan sampel dengan cara menetapkan kriteria-kriteria tertentu

Hasil pengolahan data statistik dapat disimpulkan bahwa ada pengaruh yang signifikan dan positif antara *price book value* terhadap *return* saham, tidak ada pengaruh yang signifikan antara *price earning ratio* terhadap *return* saham dan tidak ada pengaruh yang signifikan antara *dividen yield* terhadap *return* saham.

Kata Kunci : *price book value*, *price earning ratio*, *dividend yield* dan *return saham*