

**PENGARUH *EARNING PER SHARE*, *PRICE EARNING RATIO*, *PRICE TO BOOK VALUE*, *DEBT TO EQUITY RATIO* DAN *DIVIDEND YIELD*
TERHADAP *RETURN SAHAM* PADA PERUSAHAAN MANUFAKTUR
SEKTOR INDUSTRI BARANG KONSUMSI YANG TERDAFTAR DI
BURSA EFEK INDONESIA PERIODE 2019-2021**

Abstrak

Investasi saham mempunyai *return* yang cukup tinggi dan juga risiko yang tinggi pula. Investor dapat mengurangi risiko investasi saham dengan mengetahui faktor-faktor yang berpengaruh terhadap *return* saham, baik itu bersifat makro seperti Pandemi Covid-19 maupun yang bersifat mikro seperti kinerja keuangan perusahaan. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui dan menguji pengaruh *Earning Per Share* (EPS), *Price Earning Ratio* (PER), *Price to Book Value* (PBV), *Debt to Equity Ratio* (DER) dan *Dividend Yield* (DY) terhadap *return* saham pada perusahaan manufaktur sektor industri barang konsumsi yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2019-2021.

Populasi penelitian adalah perusahaan manufaktur sektor industri barang konsumsi yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2019-2021. Sampel dalam penelitian ini sebanyak 63 perusahaan manufaktur sektor industri barang konsumsi yang ditentukan berdasarkan metode *purposive sampling*. Teknik analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah analisis regresi linear berganda.

Berdasarkan hasil penelitian menunjukkan bahwa *Price Earning Ratio* (PER) dan *Dividend Yield* (DY) berpengaruh positif terhadap *return* saham, *Debt to Equity Ratio* (DER) berpengaruh negatif terhadap *return* saham, sedangkan *Earning Per Share* (EPS) dan *Price to Book Value* (PBV) tidak berpengaruh terhadap *return* saham. Penelitian selanjutnya diharapkan dapat mengembangkan penelitian ini dengan menggunakan variabel lain yang secara teori dapat mempengaruhi *return* saham, seperti *Cash Flow Per Share* (CFPS) dan *Price Cash Flow Ratio* (PCFR).

Kata kunci: *return saham, earning per share, price earning ratio, price to book value, debt to equity ratio, dividend yield*