

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh *Price Book Value*, *Debt Equity Ratio*, *Beta* dan *Size* terhadap *Stock Return* pada perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia tahun 2011-2014.

Jenis penelitian yang digunakan adalah data kuantitatif yang dilihat dari laporan keuangan per 31 Desember. Populasi yang digunakan dalam penelitian ini adalah semua perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) yang mencatatkan sahamnya (listing) pada periode 1 Januari 2011 sampai 31 Desember 2014. Dengan teknik dokumentasi dari data sekunder. Metode analisis yang digunakan adalah analisis regresi linier berganda dengan panel data yang menggunakan uji t (t-test) dan uji F (F-test).

Hasil penelitian menunjukkan bahwa *Price Book Value* dan *Beta* berpengaruh positif dan signifikan terhadap *Stock Return* sementara *Debt Equity Ratio* dan *Size* tidak berpengaruh signifikan terhadap *Stock Return*.

Kata Kunci : Price Book Value, Debt Equity Ratio, Beta, Size, Stock Return, Perusahaan Manufaktur, Bursa Efek Indonesia (BEI), laba, investasi, modal.