

INTISARI

Penelitian ini dilakukan untuk menganalisis pengaruh *Return On Equity*, *Growth*, *Dividend Payout Ratio* dan Beta terhadap *Return Saham*. Dengan menggunakan data perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia dan total sebanyak 15 perusahaan.

Teknik pengambilan sampel yang digunakan adalah *purposive sampling*. Data diperoleh dari website Bursa Efek Indonesia, Pojok BEI UMY dan *Indonesian Capital Market Directory (ICMD)*. Teknik analisis yang digunakan adalah regresi linier berganda. Selain itu digunakan uji asumsi klasik yang meliputi uji normalitas, uji multikolinieritas, uji heterokedastisitas, dan uji autokolerasi.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa : *return on equity* berpengaruh signifikan terhadap *return* saham dengan nilai signifikan 0,005; *growth* tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham dengan nilai signifikan 0,076; *dividend payout ratio* tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham dengan nilai signifikan 0,525; beta saham berpengaruh signifikan terhadap *return* saham dengan nilai signifikan 0,001.

Kata Kunci : *return on equity*, *growth*, *dividend payout ratio*, beta, *return* saham