

## ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menguji pengaruh Rasio Solvabilitas: *Debt to Equity Ratio* (DER), Rasio Profitabilitas: *Return on Equity* (ROE), dan Rasio Pasar: *Dividend Yield* terhadap *Return Saham* pada perusahaan Otomotif dan Komponen yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia selama periode tahun 2010 sampai dengan tahun 2014.

Metode penelitian yang digunakan dalam penelitian ini adalah metode deskriptif asosiatif. Penelitian ini dilakukan dengan menggunakan data sekunder. Populasi dalam penelitian ini adalah perusahaan yang masuk dalam indeks Otomotif dan Komponen di Bursa Efek Indonesia dari tahun 2010-2014. Metode pengambilan sampel menggunakan teknik *Purposive Sampling*. Analisis statistik yang digunakan dalam penelitian ini adalah asumsi klasik, korelasi, regresi berganda dan koefisien determinasi sedangkan pengujian hipotesis yang digunakan adalah metode statistik uji *t* dan uji *F*.

Hasil analisis regresi menunjukkan bahwa secara simultan, *Debt to Equity Ratio* (DER), *Return on Equity* (ROE), dan *Dividend Yield* berpengaruh signifikan terhadap *return* saham dan memiliki pengaruh sebesar 42,2% terhadap *return* saham, sedangkan sisanya sebesar 57,8% dipengaruhi oleh faktor lain meliputi kondisi perdagangan ekonomi, fluktuasi kurs, volume dan frekuensi transaksi serta kekuatan pasar, kondisi ekonomi, politik dan keamanan negara, tingkat inflasi dan kebijakan moneter.

Kata kunci: *Return Saham*, *Debt to Equity Ratio* (DER), *Return on Equity* (ROE), dan *Dividend Yield*.