

ABSTRAK

Penelitian ini dilakukan untuk melihat bagaimana pengaruh rasio keuangan yang berupa *price to equity ratio*, *earning per share* dan *debt to equity ratio* serta melihat pengaruh dari *market capitalization* terhadap *stock market returns*.

Populasi pada riset ini yaitu seluruh perusahaan yang masuk kedalam indeks KOMPAS100 pada periode 2019-2021. Sampel diambil dengan metode *purposive sampling*. Total sampel sebanyak 55 perusahaan dengan total 124 data. Analisis regresi berganda digunakan dalam pengujian hipotesis penelitian.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa semua variabel yang ada pada penelitian ini tidak memiliki pengaruh terhadap *stock market returns*.

Kata kunci: *price to equity ratio*, *earning per share*, *debt to equity ratio*, *market capitalization*, *stock market returns*.