

## ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menguji pengaruh *book to market equity*, *firm size*, *market value added* (MVA), *momentum*, dan *trading volume* terhadap *return* saham. Sampel yang digunakan dalam penelitian ini adalah perusahaan yang terdaftar dalam indeks LQ-45 di Bursa Efek Indonesia (BEI) tahun 2012-2016. Penelitian ini dibuat karena masih terdapat perbedaan hasil penelitian antara penelitian yang satu dengan yang lain.

Untuk memperoleh hasil penelitian yang valid, teknik pengambilan sampel yang digunakan dalam penelitian ini adalah metode *purposive sampling* sehingga diperoleh sampel sebanyak 24 perusahaan. Analisis yang digunakan adalah analisis regresi berganda yang didahului dengan uji asumsi klasik yang terdiri dari uji normalitas, uji multikolinieritas, uji heterokedastisitas dan uji autokorelasi. Pengujian hipotesis dilakukan dengan menggunakan uji F dan uji t.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa *book to market equity* secara signifikan berpengaruh negatif terhadap *return* saham dan variabel *trading volume* secara signifikan berpengaruh positif terhadap *return* saham. Selanjutnya, *firm size*, *market value added* dan *momentum* tidak berpengaruh terhadap *return* saham. Selain itu diperoleh nilai *adjusted R square* sebesar 19,1 %. Ini berarti sebesar 80.9% dijelaskan oleh variabel lain diluar model.

Kata kunci: *Return* saham, *book to market equity*, ukuran perusahaan, *market value added* (MVA), *momentum*, dan volume perdagangan saham.