

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh indeks harga saham individual, harga saham masa lalu, *debt to equity ratio*, dan *net profit margin* terhadap *return* saham pada perusahaan *consumer goods industry* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2015-2018 secara simultan dan parsial. Penelitian ini menggunakan metode kuantitatif dengan 27 perusahaan sebagai sampel penelitian. Teknik analisis yang digunakan yaitu analisis regresi berganda. Hasil penelitian ini adalah indeks harga saham individual, harga saham masa lalu, *debt to equity ratio*, dan *net profit margin* secara simultan berpengaruh nyata terhadap *return* saham. Secara parsial IHSI dan HSML berpengaruh nyata terhadap *return* saham, sedangkan DER dan NPM tidak berpengaruh nyata terhadap *return* saham. Besarnya koefisien determinasi menunjukkan bahwa hanya 13,3% *return* saham dapat menjelaskan IHSI, HSML, DER, dan NPM sedangkan sisanya 86,7% dijelaskan oleh faktor-faktor lain yang tidak diteliti dalam penelitian ini. Kesimpulan dari penelitian ini ialah hanya IHSI dan HSML berpengaruh nyata terhadap *return* saham pada perusahaan *consumer goods industry* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2015-2018.

Kata Kunci: *IHSI, HSML, DER, NPM, dan RS*

