

## ABSTRAK

**Yulia Maolida Sari (1158020340): Pengaruh *Return On Assets* (ROA), *Return On Equity* (ROE) dan Risiko terhadap *Return Saham* pada Perusahaan Sektor Manufaktur yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) Periode 2013 – 2017.**

Penelitian ini dilatarbelakangi oleh ketertarikan peneliti terhadap kinerja perusahaan atas tingkat keuntungan yang dinikmati dari suatu investasi yang disebut dengan *return* saham. Disamping itu, terdapat dugaan bahwa *Return On Assets* (ROA), *Return On Equity* (ROE) dan risiko berpengaruh positif terhadap *return* saham. Hal tersebut dikemukakan oleh teori yaitu ketika *Return On Assets* (ROA), *Return On Equity* (ROE) dan risiko naik maka *return* saham akan naik. Begitupun sebaliknya, apabila *Return On Assets* (ROA), *Return On Equity* (ROE) dan risiko menurun maka *return* saham akan turun.

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh *Return On Assets* (ROA), *Return On Equity* (ROE) dan risiko terhadap *return* saham baik secara parsial maupun secara simultan pada perusahaan sektor manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2013 – 2017. Dimana variabel independen dalam penelitian ini adalah *Return On Assets* (ROA), *Return On Equity* (ROE) dan risiko. Sedangkan variabel dependen dalam penelitian ini adalah *return* saham.

Metode penelitian yang digunakan adalah metode penelitian deskriptif dan verifikatif dengan menggunakan pendekatan kuantitatif yang menggunakan data panel dan sumber data yang digunakan yaitu data sekunder. Metode analisis yang digunakan yaitu uji chow dan uji hausman melalui pendekatan *common effect model*, *fixed effect model* dan *random effect model*. Lalu menganalisis hasil pengaruh variabel melalui uji-t (uji pengaruh parsial), uji-f (uji pengaruh simultan) dan uji koefisien determinasi.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa secara parsial *Return On Assets* (ROA) tidak berpengaruh negatif terhadap *return* saham, *Return On Equity* (ROE) tidak berpengaruh positif terhadap *return* saham dan risiko berpengaruh positif terhadap *return* saham. Secara simultan ketiga variabel *Return On Assets* (ROA), *Return On Equity* (ROE) dan risiko berpengaruh positif terhadap *return* saham. Kemudian secara determinasi dihasilkan 37% artinya *Return On Assets* (ROA), *Return On Equity* (ROE) dan Risiko secara bersama-sama tidak dapat menjelaskan variabel dependen yaitu *return* saham, sisanya kemungkinan dijelaskan oleh sebab-sebab diluar model.

**Kata kunci:** *Return On Assets* (ROA), *Return On Equity* (ROE), Risiko dan *Return Saham*.