

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh kinerja keuangan dan risiko terhadap *return* saham pada perusahaan sektor *consumer goods industry* di BEI. Data yang digunakan dalam penelitian ini diperoleh dari laporan keuangan dan harga saham periode 2012-2016. Metode analisis data yang digunakan yaitu analisis linier berganda, uji t, uji F, dan analisis koefisien determinasi. Dari regresi linier berganda diperoleh persamaan regresi $RS = 0,326 - 0,113CR - 0,048DER + 1,996ROA - 0,077$. Konstanta sebesar 0,326 adalah nilai *return* saham jika variabel *current ratio*, *debt to equity ratio*, *return on assets* dan *beta* bernilai nol. Koefisien regresi *current ratio* sebesar -0,113 memberikan pengaruh negatif terhadap *return* saham. Koefisien *debt to equity ratio* sebesar -0,048 memberikan pengaruh negatif terhadap *return* saham. Koefisien *return on assets* sebesar 1,996 memberikan pengaruh positif terhadap *return* saham. Koefisien *beta* sebesar -0,077 memberikan pengaruh negatif terhadap *return* saham. Secara parsial (uji t), *debt to equity ratio* dan *beta* memiliki pengaruh positif dan tidak signifikan terhadap *return* saham, sedangkan variabel *current ratio* dan *return on assets* memiliki pengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham. Sedangkan untuk uji secara simultan (uji F) *current ratio*, *debt to equity ratio*, *return on assets*, dan *beta* secara simultan berpengaruh positif signifikan terhadap *return* saham pada perusahaan sektor *consumer goods industry* di BEI. Maka koefisien determinasi diketahui bahwa *current ratio*, *debt to equity ratio*, *return on assets* dan *beta* mempengaruhi *return* saham perusahaan sektor *consumer goods industry* sebesar 13,6%, sedangkan sisanya 86,4% dipengaruhi oleh variabel lain diluar model penelitian ini.