

ABSTRAK

**PENGARUH *RISK PROFILE*, *EARNINGS* DAN *CAPITAL* TERHADAP
RETURN SAHAM PERUSAHAAN PERBANKAN
(STUDI PADA LIMA BANK DENGAN ASET TERBESAR DI INDONESIA
PERIODE 2011 – 2013)**

Penelitian ini dilakukan untuk melihat apakah terdapat pengaruh yang signifikan dari *risk profile*, *earnings* dan *capital* terhadap tingkat pengembalian/*return* saham. Jenis data yang digunakan pada penelitian ini adalah data kuantitatif yang merupakan data sekunder, yaitu laporan keuangan tahunan lima bank dengan total aset terbesar tahun 2011 periode 2011 – 2013. Untuk mengolah data dan menarik kesimpulan, penulis menggunakan metode analisis data panel dengan tingkat signifikansi 5%, dimana metode ini digunakan untuk mengetahui ada tidaknya pengaruh dari variabel bebas terhadap variabel terikat dan sebagai alat pengolahan data menggunakan *Eviews*.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa *Risk Profile*, *Earnings* dan *Capital* secara simultan berpengaruh signifikan terhadap *return* saham lima perusahaan perbankan dengan total aset terbesar tahun 2011 di Indonesia dengan persentase pengaruh sebesar 65,51%. Sedangkan secara parsial hanya variabel *risk profile* yang berpengaruh signifikan terhadap *return* saham.

Kata kunci : NPL, ROA, CAR dan *return* saham