

ABSTRAK

Nur Resti Dwi Apriliyani, NIM . 3403150115. “Pengaruh Likuiditas Saham dan Risiko Sistematis Terhadap *Return* Saham (Suatu Studi Pada Perusahaan Subsektor Pertambangan Minyak dan Gas Bumi yang Tercatat di Bursa Efek Indonesia Periode 2014-2018)”. Dibawah bimbingan Mohamad Apip, S.E., M.Si. (Pembimbing I) dan Dani Usmar, S.E., M.Si.Ak. (Pembimbing II).

Hasil penelitian ini menunjukkan koefisien determinasi diperoleh nilai R square sebesar 0,747 atau 74,7%. Berarti variabel likuiditas saham dan risiko sistematis memberikan pengaruh sebesar 74,7% terhadap variabel return saham. Hasil pengujian statistik menunjukkan bahwa secara parsial likuiditas saham berpengaruh positif dan signifikan terhadap return saham, dan risiko sistematis tidak berpengaruh positif signifikan terhadap return saham. Kemudian hasil pengujian secara simultan menunjukkan bahwa variabel likuiditas saham dan risiko sistematis berpengaruh positif signifikan terhadap return saham pada perusahaan subsektor pertambangan minyak dan gas bumi yang tercatat di Bursa Efek Indonesia periode 2014-2018.

Kata Kunci : Likuiditas Saham, Risiko Sistematis, Return Saham