

Abstrak

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui pengaruh antara risiko perbankan terhadap *return* saham pada sektor perbankan yang terdaftar dalam Bursa Efek Indonesia pada tahun 2007-2010. Variabel dependen dalam penelitian ini adalah *return* saham perbankan dan variabel independen adalah risiko perbankan yang terdiri dari risiko tingkat suku bunga, risiko kredit, risiko solvensi, risiko likuiditas, dan risiko nilai tukar. Populasi dalam penelitian ini adalah perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia pada tahun 2007-2010 sebanyak 38 perusahaan. Sampel dalam penelitian ini sebanyak 21 perusahaan perbankan yang telah memenuhi persyaratan untuk penelitian. Data yang digunakan untuk mengetahui *return* saham adalah dengan menggunakan data harian harga saham masing-masing perbankan yang dihitung tahunan. Data yang digunakan untuk mengetahui masing-masing risiko perbankan adalah dengan menggunakan data sekunder dari Bursa Efek Indonesia berupa laporan keuangan perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia pada tahun 2007-2010. Metode yang digunakan adalah analisa regresi linear berganda dan hasil yang diperoleh menunjukkan 1) Risiko tingkat suku bunga berpengaruh negatif terhadap *return* saham, 2) Tidak ada pengaruh negatif antara risiko kredit dengan *return* saham, 3) Tidak ada pengaruh negatif antara risiko solvensi dengan *return* saham, 4) Tidak ada pengaruh negatif antara risiko likuiditas dengan *return* saham, 5) Tidak ada pengaruh negatif antara risiko nilai tukar terhadap *return* saham.

Kata kunci : Perbankan, Return saham, Risiko tingkat suku bunga, Risiko kredit, Risiko solvensi, Risiko likuiditas, Risiko nilai tukar