

ABSTRAK

ANALISIS PENGARUH TINGKAT KESEHATAN BANK TERHADAP RETURN SAHAM (Studi Kasus pada Perusahaan Perbankan *Go Public* yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2013-2016)

Kesehatan bank merupakan kemampuan Bank untuk melaksanakan kegiatan operasional perbankan secara normal dan mampu memenuhi semua kewajibannya dengan baik. Bank yang memiliki kesehatan bank yang baik akan menarik para investor untuk menanamkan sahamnya pada bank tersebut, sehingga berpengaruh terhadap *return* saham. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui bagaimana pengaruh tingkat kesehatan bank dengan metode RGEC yang terdiri dari *Risk Profile* (NPL), *Good Corporate Governance (Self Assessment)*, *Earnings* (ROA), dan *Capital* (CAR) terhadap return saham pada perusahaan perbankan *go public*. Sampel penelitian ini adalah sebanyak 26 perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia pada periode 2013-2016. Jenis data yang digunakan adalah data sekunder berupa laporan tahunan perusahaan yang dijadikan sampel. Alat uji data menggunakan software SPSS 21 meliputi analisis statistik deskriptif, uji asumsi klasik, dan uji hipotesis: regresi linear berganda, uji koefisien determinasi (R^2), uji kelayakan model regresi (Uji F) dan Uji t. Hasil penelitian menunjukkan bahwa variabel *rentability/earnings* (ROA) terbukti berpengaruh positif terhadap *return* saham dan variabel *Capital* (CAR) terbukti berpengaruh positif terhadap *return* saham. Penelitian ini tidak membuktikan variabel risk profile (NPL) dan good corporate governance (Self Assessment) berpengaruh terhadap return saham. Kesimpulan yang dapat diberikan adalah *Rentability* dan *Capital* dapat digunakan investor sebagai alat analisis yang membantu di dalam memprediksi return saham.

Kata Kunci: *Risk Profile*, *Good Corporate Governance*, *Rentability*, *Capital*, *Return Saham*