

ABSTRAK

**PENGARUH *ENTERPRISE RISK MANAGEMENT* (ERM), UKURAN PERUSAHAAN, PROFITABILITAS, DAN *LEVERAGE* TERHADAP *RETURN SAHAM*
(Studi pada Perusahaan Perbankan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2015-2019)**

Oleh

WIDI HASTARI

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh pengaruh *enterprise risk management*, ukuran perusahaan, profitabilitas, dan *leverage* terhadap *stock return*. Penelitian ini dilakukan pada perusahaan perbankan yang terdaftar di bursa efek indonesia periode 2015-2019. Teknik pengambilan sampel yang digunakan dalam penelitian ini adalah teknik *purposive sampling*. Sampel terdiri dari 16 perusahaan perbankan. Metode analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah analisis regresi linear berganda. Data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data sekunder yaitu harga saham penutupan tahunan dan laporan tahunan periode 2015-2019. Hasil penelitian ini membuktikan bahwa secara parsial hanya variabel profitabilitas yang berpengaruh terhadap *stock return*. Sedangkan variabel *enterprise risk management*, ukuran perusahaan, dan *leverage* secara parsial tidak berpengaruh signifikan terhadap *stock return*. Secara simultan *enterprise risk management*, ukuran perusahaan, profitabilitas, dan *leverage* berpengaruh signifikan terhadap *stock return*.

Kata Kunci: *Enterprise Risk Management*, Ukuran Perusahaan, Profitabilitas, dan *Leverage*

ABSTRACT

THE EFFECT OF ENTERPRISE RISK MANAGEMENT, FIRM SIZE PROFITABILITY, AND LEVERAGE ON STOCK RETURN IN BANKING COMPANIES LISTED IN INDONESIAN STOCK EXCHANGE ON 2015-2019

By

WIDI HASTARI

This study aims to determine the effect of enterprise risk management, firm size, profitability, and leverage to stock return. This study was performed on companies listed in Indonesian stock exchange 2015-2019. The sampling technique that used in this research is purposive sampling. This study has 16 banking companies samples. Data analyze technique that used is multiple linear regression analyze. The result of this research found that profitability has significant effect to stock return. Meanwhile the enterprise risk management, firm size, and leverage not significant effect to stock return. Simultaneously enterprise risk management, firm size, profitability, and leverage have significant effect on stock return.

Key word: Enterprise Risk Management, firm size, Profitability, and Leverage