

ABSTRAK

PENGARUH LIKUIDITAS SAHAM DAN RISIKO SISTEMATIS TERHADAP *RETURN* SAHAM (Pada PT. Astra Agro Lestari, Tbk. Periode 2009-2018)

**Oleh:
DERYANA
163402169**

**Di bawah bimbingan:
Deden Mulyana
Mochammad Soleh Soeaidy**

Tujuan penelitian ini adalah untuk mengetahui dan menganalisis pengaruh Likuiditas Saham dan Risiko Sistematis terhadap *Return* Saham. Metode penelitian yang digunakan adalah metode survei mengenai data Likuiditas Saham, Risiko Sistematis, dan *Return* Saham pada PT. Astra Agro Lestari, Tbk. periode 2009-2018 dengan menggunakan teknik *purposive sampling*. Alat analisis yang digunakan adalah Regresi Linear Berganda dan Koefisien Determinasi.

Berdasarkan hasil penelitian diketahui bahwa secara simultan Likuiditas Saham dan Risiko Sistematis berpengaruh signifikan terhadap *Return* Saham. Sedangkan secara parsial Likuiditas Saham berpengaruh tidak signifikan terhadap *Return* Saham dan Risiko Sistematis berpengaruh signifikan terhadap *Return* Saham.

Kata Kunci: likuiditas saham, risiko sistematis, *return* saham.