

EFFECT OF SHARE RISK LEVEL ON STOCK RETURN

(Survey of Food and Beverage Sub-Sector Manufacturing Companies Listed on the Indonesia Stock Exchange 2013-2018)

ZILAN BHRUL AKMAN

133403117

Accounting Department, Economic and Business Faculty

Siliwangi University

2020

ABSTRACT

This study aims to determine the level of risk of shares on stock returns and to examine the effect of the level of risk on stock returns in manufacturing companies in the food and beverage sub-sector listed on the Indonesia Stock Exchange in 2013-2018. The sampling technique used was purposive sampling. The data analysis technique used is panel data regression. The results showed that the Stock Risk Level and Stock Return had a fluctuating value. Then for the Stock Risk Level has a negative and insignificant effect on Stock Return.

Keywords: Stock Risk Level, Stock Return

PENGARUH TINGKAT RISIKO SAHAM TERHADAP RETURN SAHAM

(Survei Pada Perusahaan Manufaktur Sub Sektor Makanan Dan Minuman Yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2013-2018)

ZILAN BAHRUL AKMAN

133403117

Jurusan Akuntansi, Fakultas Ekonomi dan Bisnis

Universitas Siliwangi

2020

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui Tingkat Risiko Saham terhadap *Return* Saham serta meneliti pengaruh Tingkat Risiko Saham terhadap *Return* Saham Pada Perusahaan Manufaktur Sub Sektor Makanan Dan Minuman Yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2013-2018. Teknik pengambilan sampel yang dilakukan yaitu *purposive sampling*. Teknis analisis data yang digunakan yaitu regresi data panel. Hasil penelitian menunjukkan bahwa Tingkat Risiko Saham dan *Return* Saham memiliki nilai yang fluktuatif. Kemudian untuk Tingkat Risiko Saham berpengaruh negatif tidak signifikan terhadap *Return* Saham.

Kata Kunci : Tingkat Risiko Saham, *Return* Saham