

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk melihat bagaimana pengaruh *Distress Risk*, Ukuran Perusahaan (*Size*), *Book to Market Ratio (BMR)*, *Return On Assets (ROA)*, dan *Debt to Equity Ratio (DER)* terhadap *return* saham. Penelitian ini dilakukan terhadap perusahaan yang telah *Go Public* dan telah mendaftarkannya di Bursa Efek Indonesia serta tergabung dalam indeks Lq45. Data yang digunakan dalam penelitian ini berasal dari publikasi *Indonesian Capital Market Directory* periode 2009-2013 dengan jumlah sampel sebanyak 25 sampel perusahaan.

Metode analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah analisis regresi berganda, kemudian menggunakan pengujian asumsi klasik dan pengujian hipotesis dengan menggunakan uji statistic F, uji statistic t dan uji koefisien determinasi (R^2) dengan tingkat signifikansi sebesar 5%

Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwa *distress risk* memiliki pengaruh yang positif namun tidak signifikan terhadap *return* saham, *size* memiliki pengaruh yang negatif dan signifikan terhadap *return* saham, BMR memiliki pengaruh yang negatif dan signifikan terhadap *return* saham, ROA dan DER tidak memiliki pengaruh yang signifikan terhadap *return* saham.

Kata Kunci : *Return Saham, Distress Risk, Ukuran Perusahaan (Size), Book to Market ratio (BMR), Return On Assets (ROA), Debt to Equity Ratio (DER)*