

## ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menguji pengaruh variabel fundamental, risiko sistematis, dan jenis perusahaan terhadap return saham perusahaan manufaktur. Variabel yang digunakan dalam penelitian meliputi profitabilitas, leverage, kinerja saham, inflasi tahunan, dan jenis perusahaan.

Populasi penelitian ini adalah perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2009 - 2011. Jenis perusahaan tersebut dibedakan menjadi perusahaan manufaktur kimia dasar dan non kimia dasar. Sehingga total sampel penelitian yang sesuai dengan kriteria tersebut berjumlah 83 perusahaan tiap tahunnya. Hipotesis dalam penelitian ini diuji dengan analisis regresi berganda.

Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwa profitabilitas dan inflasi tidak mempengaruhi besarnya return saham perusahaan manufaktur. Sedangkan variabel leverage, kinerja saham, dan jenis perusahaan berpengaruh terhadap return saham perusahaan manufaktur

Kata kunci: Profitabilitas, leverage, kinerja saham, inflasi, jenis perusahaan, return saham