

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menguji pengaruh risiko kredit, risiko pasar, risiko likuiditas, risiko modal terhadap *return* saham dengan ukuran perusahaan sebagai variabel moderating. Risiko kredit, risiko pasar, risiko likuiditas, dan risiko modal sebagai variabel independen. Variabel dependen yang digunakan pada penelitian ini adalah *return* saham. Variabel moderating yang digunakan dalam penelitian ini adalah ukuran perusahaan.

Populasi penelitian ini adalah perusahaan bank yang telah tercatat di Bursa Efek Indonesia periode 2013-2017. Teknik pengambilan sampel menggunakan metode *purposive sampling* dan diperoleh sampel akhir sejumlah 141 sampel. Penelitian ini menggunakan analisis regresi berganda dan analisis regresi moderating melalui uji nilai selisih mutlak untuk pengujian hipotesis.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa risiko kredit dan risiko modal tidak berpengaruh terhadap *return* saham. Sedangkan, risiko pasar dan risiko likuiditas berpengaruh negatif terhadap *return* saham. Ukuran perusahaan dapat memoderasi pengaruh risiko pasar terhadap *return* saham, namun tidak dapat memoderasi pengaruh risiko kredit, risiko likuiditas dan risiko modal terhadap *return* saham.

Kata kunci : Risiko Kredit, Risiko Pasar, Risiko Likuiditas, Risiko Modal, *Return* Saham, Ukuran Perusahaan.