

## ABSTRAKSI

Penelitian ini dilakukan karena adanya fenomena atau masalah yaitu penelitian terdahulu yang berbeda-beda (*research gap*). Obyek penelitian pada perusahaan sektor manufaktur dengan menggunakan tahun penelitian periode 2007 - 2010. Penelitian ini bertujuan untuk menguji secara empiris pengaruh *Debt To Equity Ratio* dan Risiko Sistematis (*Beta Saham*) terhadap *Return Saham*.

Sampel yang diambil dalam penelitian ini sebanyak 54 perusahaan. Pada penelitian ini, cara pengambilan sampel menggunakan metode *purposive sampling* yaitu pengambilan sampel didasarkan pada kriteria-kriteria yang dipandang mempunyai sangkut-paut yang erat dengan ciri-ciri atau sifat-sifat populasi.

Hasil pengolahan data statistik dapat disimpulkan bahwa tidak ada pengaruh yang signifikan antara *Debt to Equity Ratio* terhadap *Return Saham* secara parsial, ada pengaruh yang signifikan dan negative antara Risiko Sistematis (*Beta*) terhadap *Return Saham* secara parsial.

Kata Kunci : *Debt To Equity Ratio*, Risiko Sistematis dan *Return Saham*