

ABSTRAK

Nabila Indah Febriana “Analisis Pengaruh Harga Saham, *Invesment Opportunity Set*, Nilai Perusahaan dan Risiko Terhadap *Return* Saham (Studi Pada Perusahaan Telekomunikasi Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Periode 2017-2021)”. Skripsi. Program Studi Manajemen Fakultas Ekonomi Universitas Muhammadiyah Purworejo. 2022.

Peran pasar modal salah satunya menjadi informasi untuk mengetahui perusahaan yang layak untuk melakukan investasi ditinjau dari faktor-faktor yang mempengaruhi *return* saham yang akan diperoleh investor. Penelitian ini bertujuan untuk mendapatkan data/fakta yang tepat dan dapat dipercaya tentang seberapa jauh pengaruh antara harga saham, *invesment opportunity set*, nilai perusahaan dan risiko terhadap *return* saham.

Penelitian ini merupakan penelitian kuantitatif, menggunakan data sekunder dengan jumlah sampel 8 perusahaan yang diambil berdasarkan metode *purposive sampling*. Periode penelitian yang digunakan yaitu lima tahun, mulai dari tahun 2017 sampai dengan 2021. Metode yang digunakan adalah analisis regresi linier berganda dan uji asumsi klasik dengan uji statistik deskriptif, uji normalitas, uji multikolinieritas, uji heteroskedastisitas, dan uji autokorelasi. Data yang diperoleh kemudian diolah menggunakan *software* statistik SPSS 21.

Hasil pengujian menunjukkan bahwa harga saham tidak berpengaruh terhadap *return* saham, *invesment opportunity set* berpengaruh negatif terhadap *return* saham, nilai perusahaan berpengaruh positif terhadap *return* saham dan risiko berpengaruh positif terhadap *return* saham.

Kata kunci: *Return* Saham, Harga Saham, *Invesment Opportunity Set*, Nilai Perusahaan dan Risiko