

ABSTRAKSI

Penelitian ini bertujuan menganalisis pengaruh kesehatan bank terhadap return saham pada perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Kesehatan bank diukur dengan rasio-rasio keuangan yaitu: *Capital Adequacy Ratio (CAR)*, *Non Performing Loan (NPL)*, *Return On Asset (ROA)*, dan *Loan to Deposit Ratio (LDR)* sedangkan return saham diukur dengan *Abnormal Return*. Populasi penelitian ini meliputi perusahaan yang terdaftar di BEI pada periode 2011-2014. Sampel untuk penelitian ini dengan purposive sampling untuk mendapatkan sampel yang sesuai dengan kriteria yang ditentukan. Sampel dalam penelitian ini ada 23 perusahaan perbankan. Penelitian ini menggunakan data sekunder berupa laporan keuangan periode 2011-2014 yang dipublikasikan di Bursa Efek Indonesia (BEI). Teknik analisis data menggunakan uji asumsi klasik. Pengujian hipotesis dilakukan menggunakan analisis regresi berganda. Hasil penelitian membuktikan bahwa tingkat kesehatan bank tidak berpengaruh terhadap *return* saham baik secara parsial maupun simultan.

Kata Kunci: Kesehatan Bank, Return Saham. Keuangan, *Capital Adequacy Ratio (CAR)*, *Non Performing Loan (NPL)*, *Return On Asset (ROA)*, *Loan to Deposit Ratio (LDR)*.

