

## ABSTRAK

Risiko Sistematis bisa disebut juga risiko yang tidak dapat didiversifikasi (dihindarkan), disebut juga dengan risiko pasar. Risiko ini berkaitan dengan kondisi yang terjadi dipasar secara umum. *Economic Value Added* (EVA) merupakan indikator tentang adanya penambahan nilai dari suatu investasi setiap tahun pada suatu perusahaan. EVA adalah nilai tambah ekonomis yang diciptakan perusahaan dari kegiatan atau strateginya selama periode tertentu dan merupakan salah satu cara menilai kinerja Keuangan. *Financial Distress* adalah ketidakmampuan perusahaan untuk membayar kewajiban keuangannya pada saat jatuh tempo yang menyebabkan kebangkrutan perusahaan. *Return* merupakan salah satu faktor yang memotivasi investor berinvestasi dan merupakan imbalan atas keberanian investor menanggung risiko atas investasi yang dilakukannya

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui Pengaruh Risiko Sistematis, *Economic Value Added*, dan Model *Financial Distress* Fulmer terhadap *Return* Saham pada perusahaan Konstruksi dan Bangunan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2010-2014 secara parsial maupun simultan.

Populasi dalam penelitian ini adalah perusahaan subsektor konstruksi dan bangunan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia tahun 2010-2014. Berdasarkan *purposive sampling*, diperoleh sebanyak 5 sampel.

Penelitian ini menggunakan teknik analisis data berupa perhitungan masing-masing variabel, uji asumsi klasik dilanjutkan dengan metode regresi berganda. Hasilnya akan dilakukan uji F, uji t dan koefisien determinasi.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa secara simultan terdapat pengaruh Risiko Sistematis, *Economic Value Added*, dan Model *Financial Distress* Fulmer terhadap *Return* Saham. Secara parsial Risiko Sistematis dan *Economic Value Added* tidak berpengaruh signifikan terhadap *Return* Saham. hanya Model *Financial Distress* Fulmer yang memiliki pengaruh signifikan negatif terhadap *Return* Saham.

Kata Kunci : Risiko Sistematis, *Economic Value Added*, *Financial Distress*, Fulmer, *Return* Saham.