

Abstrak

Menurut Undang-Undang Nomor 10 Tahun 1998 tentang Perbankan, Bank wajib memelihara kesehatannya. Kesehatan bank yang merupakan cerminan kondisi dan kinerja bank menjadi sarana bagi otoritas pengawas dalam menetapkan strategi dan fokus pengawasan terhadap bank. Berdasarkan peraturan Bank Indonesia No. 13/JPBI/2011 bank wajib melakukan penilaian tingkat kesehatan dengan menggunakan pendekatan risiko (*Risk Based Bank Rating*) baik secara individual maupun konsolidasi. Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh tingkat kesehatan bank terhadap *return* saham secara simultan maupun secara parsial.

Populasi pada penelitian ini adalah perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia tahun 2011-2013. Sampel penelitian berjumlah 4 perusahaan yang dipilih dengan metode *purposive sampling*, dengan periode pengamatan 3 tahun. Metode analisis data dalam penelitian ini adalah regresi data panel dengan software statistik EViews 7.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa : (1) *Non Performing Loan* (NPL), *Loan to Deposit Ratio* (LDR), *Interest Rate Risk* (IRR), *Good Corporate Governance* (GCG), Beban Operasional pada Pendapatan Operasional (BOPO), dan *Capital Adequacy Ratio* (CAR) secara simultan tidak mempunyai pengaruh yang signifikan terhadap *return* saham dengan nilai koefisien determinasi (R^2) sebesar 18,0388%, (2) *Non Performing Loan* (NPL), *Loan to Deposit Ratio* (LDR), *Interest Rate Risk* (IRR), *Good Corporate Governance* (GCG), Beban Operasional pada Pendapatan Operasional (BOPO), dan *Capital Adequacy Ratio* (CAR) secara parsial tidak mempunyai pengaruh yang signifikan terhadap *return* saham.

Kata kunci : tingkat kesehatan bank, *return* saham