

ABSTRAK

Tujuan penelitian ini adalah untuk melihat pengaruh faktor fundamental terhadap beta saham. Faktor fundamental yang digunakan adalah *Asset Growth* (AG), *Debt to Equity Ratio* (DER), dan *Return on Equity* (ROE). Populasi yang digunakan pada penelitian ini adalah salah satu dari perusahaan jasa yaitu perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) tahun 2015-2019 dengan jumlah populasi sebanyak 41 perusahaan dan sebagai sampel dengan observasi sebanyak 205 kali observasi. Data yang digunakan adalah laporan keuangan dan *annual report* tahun 2015-2019 serta diperoleh dari situs idx dan yahoo.financial untuk menentukan *return* saham dan *return* pasar. Metode analisis yang digunakan adalah analisis regresi linear berganda. Alat analisis yang digunakan adalah eviws-9. Hasil pengujian penelitian menunjukkan *Asset Growth* secara parsial berpengaruh negatif dan signifikan terhadap beta saham. *Debt to Equity Ratio* secara parsial berpengaruh negatif dan signifikan terhadap beta saham. *Return on Equity* secara parsial berpengaruh positif dan signifikan terhadap beta saham. Penulis menyarankan kepada perusahaan dan khususnya investor untuk memperhatikan risiko yang ada, hasil penelitian ini diharapkan mampu menjadi bahan pertimbangan dalam mengelola kinerja perusahaan dan memberikan informasi yang baik bagi investor.

Kata kunci : *Beta Saham, Asset Growth, Debt to Equity Ratio dan Return on Equity*