

## SUMMARY

# PENGARUH RETURN PASAR, SIZE, BID-ASK SPREAD, RETURN ON EQUITY DAN SUKU BUNGA SBI TERHADAP RETURN SAHAM PADA SAHAM-SAHAM AKTIF DI BURSA EFEK INDONESIA

Created by CATUR SULISTYA W.

- Subject** : PENGARUH RETURN PASAR, SIZE, BID-ASK SPREAD, RETURN ON EQUITY DAN SUKU BUNGA SBI TERHADAP RETURN SAHAM PADA SAHAM-SAHAM AKTIF DI BURSA EFEK INDONESIA
- Subject Alt** : PENGARUH RETURN PASAR, SIZE, BID-ASK SPREAD, RETURN ON EQUITY DAN SUKU BUNGA SBI TERHADAP RETURN SAHAM PADA SAHAM-SAHAM AKTIF DI BURSA EFEK INDONESIA
- Keyword** : PENGARUH RETURN PASAR, SIZE, BID-ASK SPREAD, RETURN ON EQUITY DAN SUKU BUNGA SBI TERHADAP RETURN SAHAM PADA SAHAM-SAHAM AKTIF DI BURSA EFEK INDONESIA

### Description :

Tujuan penelitian ini dibuat untuk (1) untuk mengungkap bukti secara empiris bagaimana return pasar, size, bid-ask spread, faktor fundamental yang diwakili oleh return on equity dan suku bunga SBI mempengaruhi return saham pada saham-saham aktif di Bursa Efek Indonesia (BEI); (2) untuk menganalisis variabel-variabel manakah yang paling berpengaruh dan lebih kuat menjelaskan return saham pada saham-saham aktif di Bursa Efek Indonesia (BEI).

Metode yang digunakan dalam penelitian ini adalah analisis regresi linear berganda, untuk melihat hubungan antar variabel bebas dan variabel tidak bebas melalui uji multikolinieritas, uji heteroskedasitas, dan uji otokorelasi. Sedangkan uji hipotesanya menggunakan (1) uji statistik-F (ANOVA) yaitu untuk melihat pengaruh seluruh variabel independen secara simultan terhadap variabel dependen; (2) uji statistik-t yaitu untuk melihat seberapa jauh pengaruh satu variabel independen secara individual dalam menerangkan variabel dependen.

Hasil menunjukkan secara simultan bahwa kelima variabel independen yaitu return pasar, size, bid-ask spread, ROE dan SBI berpengaruh signifikan terhadap return saham. Kemampuan variabel independen tersebut menjelaskan variabilitas return saham cukup kuat, yang ditunjukkan oleh nilai koefisien korelasi sebesar 75,9% dengan nilai koefisien determinasi ( $R^2$ ) sebesar 57,5%. Secara parsial hasil menunjukkan hanya return pasar dan return on equity secara signifikan berpengaruh positif terhadap return saham dengan nilai signifikansi 0,000. Dapat diartikan bahwa return pasar mencerminkan kondisi bursa saham di BEI yang berarti saham-saham aktif lebih responsive memberikan harapan. Sedangkan ROE sebagai indikator prospek perusahaan merupakan rasio yang cukup penting karena mencerminkan efisiensi dan efektivitas perusahaan dalam mendapatkan laba bersih berdasarkan jumlah modal yang tersedia, berdasarkan hal itu pasar merespon positif atas profit. Bagi calon investor yang akan membeli saham-saham suatu perusahaan dalam proses pengambilan keputusan investasi pada saham-saham aktif di Bursa Efek Indonesia (BEI), perlu mempertimbangkan faktor return pasar dan return on equity.

**Date Create** : 16/12/2014

**Type** : Text  
**Format** : pdf  
**Language** : Indonesian  
**Identifier** : UEU-Master-undergraduate\_2000-01-013  
**Collection** : undergraduate\_2000-01-013  
**Call Number** : 658.1 CSWp  
**Source** : magister these management of faculty  
**Relation Collection** Universitas Esa Unggul  
**COverage** : Civitas Akademika Universitas Esa Unggul  
**Right** : copyright2014\_Library@esaunggul

**Full file - Member Only**

If You want to view FullText...Please Register as MEMBER

**Contact Person :**

Astrid Chrisafi (mutiaraadinda@yahoo.com)

Thank You,

Astrid ( astrid.chrisafi@esaunggul.ac.id )

Supervisor