

## ABSTRAKSI

RIZKA AMALIA, NIM : 2005-11-036 Analisis Pengaruh Faktor Internal Dan Faktor Eksternal Terhadap Tingkat Pengembalian (Return Saham) Pada Perusahaan Pertambangan Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Periode 2005 – 2009. Dibawah bimbingan Bpk Drs. Sugiyanto,MM.

Tujuan Penelitian adalah (1) untuk mengetahui apakah dengan *Current Ratio (CR)*, *Net Profit Margin (NPM)*, *Total Asset Turn Over (TATO)*, *Debt To Equity Ratio (DER)*, Kurs (RKurs) dan Return Pasar (IHSG) mempengaruhi Return Saham (*return realisasi*) secara bersama-sama maupun secara individu pada industri pertambangan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2005 – 2009 ; (2) mengetahui faktor apa saja yang paling berpengaruh dominan terhadap *return* saham (*return realisasi*) perusahaan industri pertambangan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2005 – 2009.

Model yang digunakan dalam penelitian ini adalah regresi linear berganda untuk melihat hubungan antar variabel independent dan variabel dependent melalui uji multikolinieritas, heterokedasitas, autokorelasi dan uji kelayakan data dengan uji normalitas. Uji hipotesis menggunakan (1) uji t yaitu untuk melihat seberapa besar pengaruh satu variabel independent secara individual dalam menerangkan variabel dependent ; (2) uji F (ANOVA) yaitu untuk melihat pengaruh seluruh variabel independent secara simultan/bersama-sama terhadap variabel dependent.

Hasil analisis menunjukkan bahwa secara bersama-sama independent *Current Ratio (CR)*, *Net Profit Margin (NPM)*, *Total Asset Turn Over (TATO)*, *Debt To Equity Ratio (DER)*, Kurs (RKurs) dan Return Pasar (IHSG) signifikan mempengaruhi Return Saham (*return realisasi*) tidak ada variabel yang tidak signifikan dengan  $\alpha = 0,05$ . Dilihat melalui adjusted R Square sebesar 44,9% yang artinya variabel independent menjelaskan variabel dependentnya dan sisanya 55,1% dipengaruhi oleh variabel-variabel lainnya yang tidak termasuk kedalam penelitian.