

PENGARUH RISIKO SISTEMATIS TERHADAP RETURN SAHAM
(Studi Kasus Pada Perusahaan Sektor Property Yang Terdaftar di Bursa Efek
Indonesia Periode Tahun 2010-2014)

Annisa Aryani

10090311152

INTISARI

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui Pengaruh Risiko Sistematis Terhadap Return Saham (Studi Kasus Pada Perusahaan Sektor Property Yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2010-2014)”. Data yang digunakan adalah data sekunder dari laporan keuangan tahunan 9 perusahaan sektor property yang terdaftar di BEI. Metode analisis yang digunakan adalah analisis asumsi klasik, analisis regresi sederhana, analisis koefisien determinasi, uji hipotesis secara simultan.

Berdasarkan hasil penelitian, diketahui bahwa perkembangan risiko sistematis (Beta) pada perusahaan sektor property yang terdaftar di BEI terjadi adanya dinamika dan perkembangan baik ke atas maupun kebawah, dan perkembangan return saham pada perusahaan sektor property yang terdaftar di BEI juga mengalami perkembangan baik ke atas maupun ke bawah setiap tahunnya.

Kesimpulan dari penelitian ini bahwa analisis regresi sederhana yang terbentuk adalah risiko sistematis pada perusahaan sektor property yang terdaftar di BEI secara keseluruhan mengalami fluktuasi dan memiliki hubungan yang kuat terhadap return saham. Hal ini ditunjukkan oleh koefisien korelasi sebesar 8,91% dan koefisien determinasi sebesar 67,1%.

Kata kunci : Risiko Sistematis (Beta), Return Saham, Perusahaan property

PENGARUH RISIKO SISTEMATIS TERHADAP RETURN SAHAM
(Studi Kasus Pada Perusahaan Sektor Property Yang Terdaftar di Bursa Efek
Indonesia Periode Tahun 2010-2014)

Annisa Aryani

10090311152

ABSTRACT

This research as a purpose to find out systematic risk effect stock return (study case for property company sector that listed on Indonesia Stock Exchange in the period of 2010-2014). The data used is secondary data from finance annual report 9 property company sector that listed on Indonesia Stock Exchange. Analysis method used is assumption classic analysis, regression plain analysis, coefficient determination analysis, hyphotheses test, simultaneous.

Based from research, detectable that systematic risk expansion (Beta) of property company sector that listed on Indonesia Stock Exchange occurred by expansion and dynamics upper or lower, and return. Restribution expansion to property company sector registered of Indonesia Stock Exchange upper or lower annually.

Conclusion this research that regression plain analysis formed is systematic risk of the property company sector registered of Indonesia Stock Exchange overall have fluctuation and strongly connection tp stock return. It's showed by correlation coefficient amount of 8,91% and determination coefficient amount of 67,1%.

Keyword : Systematic Risk (Beta), Stock Return, Property Company.