

ABSTRAK

George Luois David Lento (02619220037)

ANALISA PENGARUH BETA, FIRM SIZE, VALUE, PROFITABILITAS, LEVERAGE, DAN LIKUIDITAS TERHADAP STOCK RETURN PADA PERUSAHAAN LQ45 NON PERBANKAN

(xvi + 112 halaman: 6 Gambar; 18 Tabel;)

Investasi saham merupakan investasi yang sangat populer belakangan ini oleh sebab itu perlu adanya pemahaman yang lebih mendalam terhadap faktor – faktor apa saja yang dapat mempengaruhi pengembalian suatu saham sehingga dalam pengambilan keputusan investasi, sebaiknya dilakukan analisis yang komprehensif dengan mempertimbangkan faktor-faktor yang relevan seperti risiko, pengembalian, kondisi ekonomi dan politik, dan lain sebagainya. Dalam penelitian ini akan berusaha menjelaskan faktor – faktor yang mempengaruhi stock return seperti Beta, Firm Size, Value, Profitabilitas, Leverage, dan Likuiditas. Sehingga dari penelitian ini diharapkan bisa memberikan manfaat sebagai masukan dan bahan pertimbangan kepada para investor yang akan berinvestasi saham pada perusahaan tertentu.

Penelitian ini menggunakan metode kuantitatif dan menggunakan aplikasi SPSS untuk membantu proses pengolahan data sekunder dari perusahaan yang terdaftar dalam index LQ45 (Non Perbankan). Teknik pengambilan sample melalui metode probability sampling dan jenis metode yang digunakan dalam penelitian ini adalah systematic sampling. Kriteria sample yaitu merupakan perusahaan non-perbankan yang terdaftar di LQ45 dalam periode penelitian 2017 sampai 2021. Hasil penelitian menunjukkan bahwa terdapat satu hipotesis yang diterima dari total enam hipotesis yang diajukan, yaitu variabel value berpengaruh negative signifikan terhadap stock return yang memiliki nilai t hitung sebesar (-2.078) dengan nilai sig (0.039).

Kata Kunci : Stock Return, Beta, Size, Value, Profitabilitas, Leverage, Likuiditas

Referensi : 40 (1952 – 2022)

ABSTRACT

George Luois David Lento (02619220037)

ANALYSIS OF THE EFFECT OF BETA, FIRM SIZE, VALUE, PROFITABILITY, LEVERAGE, LIQUIDITY ON STOCK RETURNS IN LQ45 COMPANIES (NON BANKING)

(xvi + 112 pages; 6 Pictures; 18 Tables;)

Investment in stocks has gained immense popularity lately, necessitating a more profound comprehension of the factors influencing stock returns. Making informed investment decisions involves comprehensive analysis, considering pertinent elements like risk, return rates, economic and political landscapes, among others. This study endeavors to elucidate the factors impacting stock returns, including Beta, Firm Size, Value, Profitability, Leverage, and Liquidity. Its goal is to offer insights and considerations for investors planning to invest in specific companies.

This research adopts quantitative methods and employs the SPSS application to process secondary data from companies listed in the LQ45 index specifically non banking companies. The sample selection method is probabilistic sampling, specifically systematic sampling, focusing on non-banking entities listed in LQ45 between 2017 until 2021. The research findings indicate that, among the six hypotheses proposed, one hypothesis was validated: the 'value' variable significantly influences stock returns negatively, with a computed t-value of (-2.078) and a significance value (sig) of (0.039).

Keywords : Stock Return, Beta, Size, Value, Profitability, Leverage, Likuidity

Referensi : 40 (1952 – 2022)