

**ANALISIS PENGARUH BETA, *SIZE* PERUSAHAAN, *DEBT TO EQUITY*
RATIO, *PRICE TO BOOK VALUE RATIO* TERHADAP *RETURN SAHAM*
PADA PERUSAHAAN MANUFAKTUR YANG TERDAFTAR
DI BURSA EFEK JAKARTA PERIODE 2012 – 2014**

SKRIPSI

Diajukan Sebagai Salah Satu Syarat Untuk Memperoleh Gelar

SARJANA EKONOMI

Program Studi Akuntansi – Strata 1



OLEH :

NAMA : RIZKY SISWANTO

NIM : 041202503125158

**FAKULTAS EKONOMI
UNIVERSITAS SATYA NEGARA INDONESIA
JAKARTA**

2016

KATA PENGANTAR

Puji syukur kehadiran Allah SWT yang telah memberikan Rahmat dan Karunia-Nya, sehingga penulis dapat menyelesaikan skripsi ini tepat pada waktunya dengan judul **“ANALISIS PENGARUH BETA, SIZE PERUSAHAAN, DEBT TO EQUITY RATIO, PRICE TO BOOK VALUE RATIO TERHADAP RETURN SAHAM PADA PERUSAHAAN MANUFAKTUR YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK JAKARTA PERIODE 2012 – 2014”** Skripsi ini merupakan syarat untuk memperoleh gelar Sarjana pada Program Studi Akuntansi Fakultas Ekonomi Universitas Satya Negara Indonesia.

Penghargaan dan terima kasih yang setulus-tulusnya kepada Ayahanda tercinta dan Ibunda yang kusayangi yang telah mencurahkan segenap cinta dan kasih sayang serta perhatian moril maupun materil. Semoga Allah SWT selalu melimpahkan Rahmat, Kesehatan, Karunia dan Keberkahan di dunia dan di akhirat atas budi baik yang telah diberikan kepada penulis.

Penghargaan dan terima kasih penulis berikan kepada Ibu DR. Meifida Ilyas SE.,M.Si.,Ak.,CA.,CSRS.,CSRA selaku Pembimbing I dan Ibu Indira Shinta Dewi SE.,Ak.,MM selaku Pembimbing II yang telah membantu penulisan skripsi ini. terselesaikannya skripsi ini tidak terlepas dari bantuan banyak pihak, sehingga pada kesempatan ini dengan segala kerendahan hati dan penuh rasa hormat penulis menghaturkan terima kasih yang sebesar-besarnya bagi semua pihak yang telah memberikan kontribusinya baik langsung maupun tidak langsung dalam penyusunan skripsi ini hingga selesai, terutama kepada yang saya hormati:

1. Rektor Universitas Satya Negara Indonesia, Prof. DR. Linjan P. Sinambela.,MM.,M.Pd
2. Dekan Fakultas Ekonomi Universitas Satya Negara Indonesia, Adolpino Nainggolan, SE.,M.AK
3. Ketua Jurusan Akuntansi, Nur Anissa SE., M.Si.,Ak.,CA
4. Ketua Jurusan Manajemen, Drs. GL. Hery Prasetya SE.,MM
5. Dosen Pembimbing Akademik saya Ir. Natrion SE.,M.Ak
6. Seluruh Dosen Fakultas Ekonomi beserta staff TU
7. Segenap Pimpinan Perusahaan PT Mitra Manna, Mr. Dadit Bimantono dan Mr Edy Santosa
8. Rekan Kerja Manna Group Ciputra World dan Lippo Mall Kemang
9. Teman-teman seluruh Fakultas Universitas Satya Negara Indonesia
10. Sahabat penulis, Sutriyati SE

Akhir kata penulis menyadari bahwa dalam penulisan skripsi ini masih jauh dari kesempurnaan. Karena itu, penulis memohon saran dan kritik yang sifatnya membangun demi kesempurnaannya dan semoga bermanfaat bagi kita semua.

Jakarta 25 Juli 2016

Rizky Siswanto

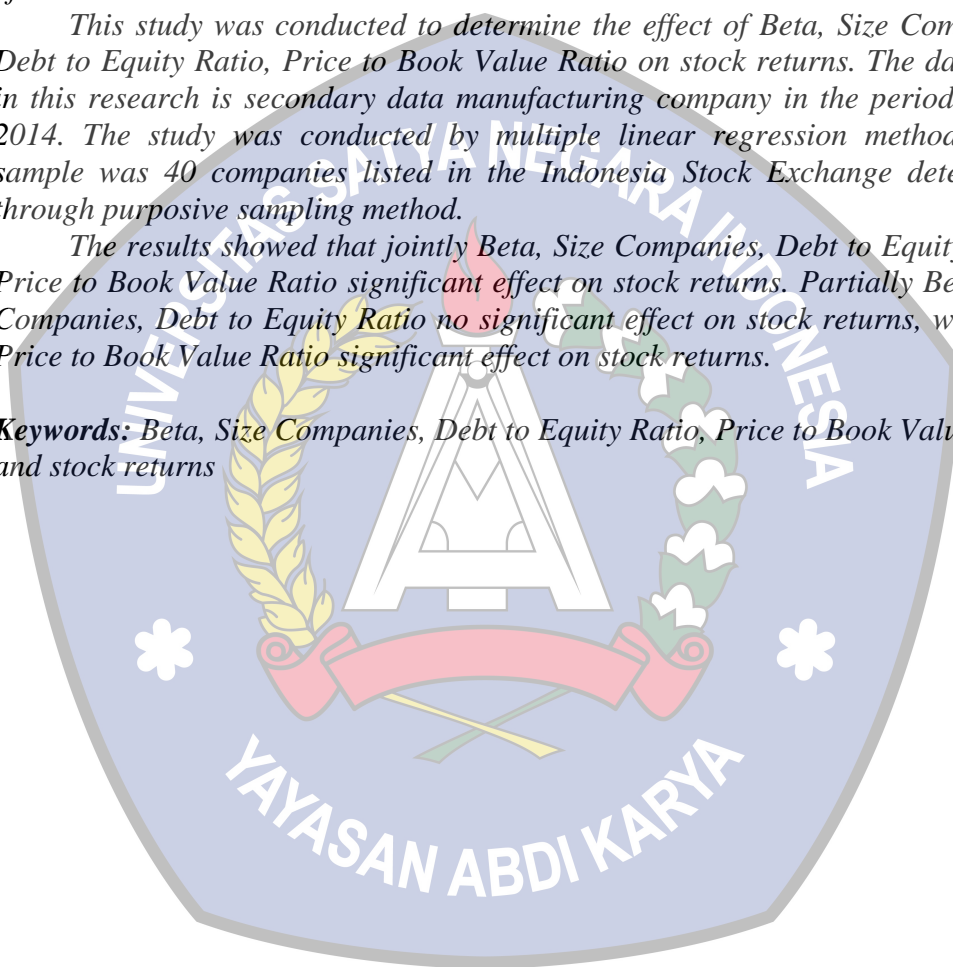
ABSTRACT

In this modern era of the stock becomes the most attractive and popular because it can be a great income to capitalize on the stock return. Each stock has a high level of risk will certainly generate a high return rate anyway. But investors need to consider other things when going to buy stocks with high levels of risk.

This study was conducted to determine the effect of Beta, Size Companies, Debt to Equity Ratio, Price to Book Value Ratio on stock returns. The data used in this research is secondary data manufacturing company in the period 2012 - 2014. The study was conducted by multiple linear regression method. Total sample was 40 companies listed in the Indonesia Stock Exchange determined through purposive sampling method.

The results showed that jointly Beta, Size Companies, Debt to Equity Ratio, Price to Book Value Ratio significant effect on stock returns. Partially Beta, Size Companies, Debt to Equity Ratio no significant effect on stock returns, while the Price to Book Value Ratio significant effect on stock returns.

Keywords: *Beta, Size Companies, Debt to Equity Ratio, Price to Book Value Ratio and stock returns*



ABSTRAK

Di era yang modern ini saham menjadi hal yang paling menarik dan banyak diminati karena dapat menjadi penghasilan yang besar dalam memperoleh keuntungan dari *return* saham. Setiap saham memiliki tingkat risiko yang tinggi tentu akan menghasilkan tingkat *return* yang tinggi pula. Tetapi para investor perlu mempertimbangkan hal lain jika akan membeli saham dengan tingkat risiko yang tinggi.

Penelitian ini dilakukan untuk mengetahui pengaruh Beta, *Size* perusahaan, *Debt to Equity Ratio*, *Price to Book Value Ratio* terhadap *return* saham. Data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data sekunder perusahaan manufaktur pada periode 2012 - 2014. Penelitian ini dilakukan dengan metode regresi linier berganda. Total sampel penelitian adalah 40 perusahaan yang terdaftar dalam Bursa Efek Indonesia yang ditentukan melalui metode *purposive sampling*.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa secara bersama-sama Beta, *Size* perusahaan, *Debt to Equity Ratio*, *Price to Book Value Ratio* berpengaruh signifikan terhadap *return* saham. Secara parsial Beta, *Size* perusahaan, *Debt to Equity Ratio* tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham, sedangkan *Price to Book Value Ratio* berpengaruh signifikan terhadap *return* saham.

Kata Kunci : Beta, *Size* perusahaan, *Debt to Equity Ratio*, *Price to Book Value Ratio* dan *return* saham