

ANALISIS PENGARUH DEBT TO EQUITY RATIO DAN BETA TERHADAP RETURN SAHAM PADA PT. ANEKA TAMBANG DI BEJ PERIODE 2001-2005

ASTRIA KARTIKA SARI, RINA NOFIANTI, SE, MM

Penulisan Ilmiah, Fakultas Ekonomi, 2007

Universitas Gunadarma

<http://www.gunadarma.ac.id>

kata kunci : saham

Abstraksi :

Tujuan dari penelitian ilmiah ini adalah mengetahui dan menganalisis pengaruh beta dan debt to equity ratio terhadap rata-rata return saham serta mengetahui dan menganalisis ada tidaknya perbedaan pengaruh beta dan debt to equity ratio terhadap rata-rata return saham pada PT. Aneka Tambang di BEJ pada periode 2001-2005. Sampel yang dipakai adalah debt to equity ratio, beta, dan return saham. Alat analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah regresi linier berganda, analisis korelasi, dan kesalahan standar estimasi. Dari hasil penelitian yang telah dilakukan dengan menggunakan tingkat signifikan sebesar 5% (0,05) diindikasikan debt to equity ratio dan beta memiliki hubungan atau berkorelasi dengan return saham atau terdapat pengaruh signifikan yang positif. Artinya, bila debt to equity ratio dan beta mengalami kenaikan, maka return saham juga akan mengalami kenaikan, begitu juga sebaliknya.