

**PENGARUH UMUR PERUSAHAAN DAN UKURAN PERUSAHAAN
TERHADAP RETURN SAHAM UNTUK PERUSAHAAN YANG MASUK
DALAM KELOMPOK LQ 45 TAHUN 2009-2010**

SKRIPSI

Nama : Yeni Nuraitin

NIM : 43109010119



FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS

UNIVERSITAS MERCU BUANA

2013

**PENGARUH UMUR PERUSAHAAN DAN UKURAN PERUSAHAAN
TERHADAP RETURN SAHAM UNTUK PERUSAHAAN YANG MASUK
DALAM KELOMPOK LQ 45 TAHUN 2009-2010**

SKRIPSI

Diajukan Sebagai Salah Satu Syarat Untuk Memperoleh Gelar

SARJANA EKONOMI

Program Studi Manajemen – Strata 1

Nama : Yeni Nuraitin

NIM : 43109010119



FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS

UNIVERSITAS MERCU BUANA

2013

SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI

Yang bertanda tangan dibawah ini :

NAMA : YENI NURAITIN

NIM : 43109010119

Program Studi : S1 Manajemen

Menyatakan bahwa skripsi ini adalah murni hasil karya sendiri. Apabila saya mengutip dari karya orang lain, maka saya mencantumkan sumbernya sesuai dengan ketentuan yang berlaku. Saya bersedia dikenai sanksi pembatalan skripsi ini apabila terbukti melakukan tindakan plagiat (penjiplakan).

Demikian pernyataan ini saya buat dengan sebenarnya.



Jakarta, 31 juli 2013



YENI NURAITIN

43109010119

UNIVERSITAS
MERCU BUANA

LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI

Nama : Yeni Nuraitin
NIM : 43109010119
Program Studi : S1 Manajemen
Judul Skripsi : Pengaruh Umur Perusahaan dan Ukuran Perusahaan
Terhadap Return Saham untuk perusahaan yang masuk
dalam kelompok LQ-45 tahun 2009-2010

Tanggal Ujian Skripsi: 31 Juli 2013

Disahkan oleh,
Pembimbing Skripsi,



(Luna Haningsih, SE, ME)

Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis

Ketua Program Studi Manajemen S1



(Dr. Wiwik Utami., Ak.,CA)



(Dr.Rina Astini, SE, MM)

LEMBAR PENGESAHAN DEWAN PENGUJI

Skripsi

Pengaruh Umur perusahaan dan Ukuran Perusahaan Terhadap Return Saham
untuk perusahaan yang masuk dalam kelompok LQ-45 tahun 2009-2010

Dipersiapkan dan Disusun oleh:

Yeni Nuraitin

43109010119

Telah dipertahankan di depan Dewan Penguji pada tanggal 31 Juli 2013

Susunan Dewan penguji

Ketua Penguji / Pembimbing Skripsi



(Luna Haningsih, SE, ME)

Anggota Dewan Penguji



UNIVERSITAS
MERCU BUANA

(Dra. Aty Herawati, M.Si)

Anggota Dewan Penguji



(Ir. Sahibul Munir, SE, M.Si)

KATA PENGANTAR

Assalamu'alaikum warahmatullahi Wabarokatuh

Segala puji dan syukur bagi Allah Rabb alam semesta. Shalawat dan salam semoga senantiasa tercurah kepada junjungan dan tauladan, Muhammad Rasulullah, keluarga dan para sahabatnya.

Alhamdulillah, Puji dan Syukur atas rahmat dan karunia kekuatan yang diberikan Allah padaku, hingga akhirnya penulis dapat menyelesaikan skripsi dengan berjudul PENGARUH UMUR PERUSAHAAN DAN UKURAN PERUSAHAAN TERHADAP RETURN SAHAM skripsi ini tersusun sebagai salah satu syarat untuk menyelesaikan pendidikan program Sarjana Strata Satu (S1) pada Fakultas Ekonomi Universitas Mercu Buana, Jakarta.

Penulis menyadari sepenuhnya bahwa dalam penyusunan skripsi ini, telah mendapat bantuan dari berbagai pihak. Oleh karena itu, penulis mengucapkan terima kasih kepada.

1. Bapak Dr. Ir. Arisetyanto Nugroho, MM. selaku Rektor Universitas Mercu Buana
2. Ibu Dr. Wiwik Utami Ak, MS, selaku Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Mercubuana.
3. Ibu Rina Astini, S.E, M.E, selaku Ketua Program Studi Manajemen S1 Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Mercubuana.
4. Ibu Luna Haningsih, S.E, M.M. selaku Dosen Pembimbing skripsi yang telah meluangkan waktu, tenaga dan pikirannya untuk memberikan bimbingan dan pengarahan yang bermanfaat dalam penyusunan laporan ini.
5. Kedua orang tuaku, yang tiada henti memberikan motivasi, dukungan baik moril dan materi, juga doa yang tidak pernah berhenti tercurahkan untukku.
6. Adik-adikku tersayang, Jajang, Adi, Rizki atas dukungannya sehingga terselesainya skripsi ini.

7. Sahabat-sahabatku yang terbaik, Suci, Anggun, Rizka, andri, Sari, Tika, Ika, Yefi, Dede atas kebersamaannya selama ini, dan senantiasa bersedia membantu dalam penyusunan skripsi ini.
8. Riana Suherman, terima kasih telah membantu dan memberi dukungan kepada penulis hingga terselesainya skripsi ini.
9. Citra jakub, terima kasih telah memberikan nasehat yang mendorong penulis, serta dengan ikhlas membantu menemani Penulis hingga terselesainya skripsi ini.
10. Seluruh rekan-rekan seperjuangan manajemen S1 angkatan 2009 yang tidak dapat disebutkan satu per satu atas kebersamaan selama menuntut ilmu di kampus tercinta

Penulis juga menyampaikan ucapan terima kasih kepada semua pihak yang tidak dapat penulis sebutkan satu persatu atas segala doa, dukungan dan bantuannya.

Penulis menyadari bahwa masih terdapat kekurangan dalam penyusunan skripsi ini. Maka dari itu, penulis mengharapkan masukan, saran dan kritik yang membangun demi kesempurnaan skripsi ini. Semoga tulisan ini dapat bermanfaat bagi pembaca sendiri, bagi masyarakat, bangsa dan Negara.

UNIVERSITAS
MERCU BUANA

Jakarta, 31 Juli 2013

Yeni Nuraitin

DAFTAR ISI

LEMBAR PERNYATAAN KARYA SENDIRI	i
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	ii
LEMBAR PENGESAHAN DEWAN PENGUJI	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	vii
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
ABSTRAK	xiii
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Tujuan dan Manfaat Penelitian	4
BAB II LANDASAN TEORI	
2.1 Manajemen Keuangan	6
2.2 Laporan Keuangan	
2.2.1 Pengertian Laporan Keuangan	9
2.2.2 Tujuan Laporan Keuangan	9
2.2.3 Bentuk-bentuk Laporan Keuangan	11
2.2.4 Keterbatasan Laporan Keuangan	12
2.3 Pasar Modal	
2.3.1 Pengertian Pasar Modal	13
2.3.2 Peran Pasar Modal	14
2.4 Indeks LQ 45	15
2.5 Investasi	
2.5.1 Pengertian Investasi	16

2.5.2	Bentuk Investasi	17
2.6	Saham	
2.6.1	Pengertian Saham	17
2.6.2	Pengertian Harga Saham	18
2.6.3	Jenis-jenis Saham	19
2.6.4	Keuntungan Saham	22
2.6.5	Resiko-resiko Saham	22
2.7	Return Saham	
2.7.1	Pengertian Return Saham	24
2.7.2	Jenis-jenis Return Saham	25
2.7.3	Cara Mengukur Return Realisasi Saham	25
2.8	Ukuran Perusahaan	26
2.9	Umur Perusahaan	29
2.10	Penelitian Terdahulu	30
2.11	Kerangka Pemikiran	31
BAB III	METODE PENELITIAN	
3.1	Obyek Penelitian	32
3.2	Desain Penelitian	32
3.3	Hipotesis	32
3.4	Variabel dan Skala Pengukuran	
3.4.1	Variabel Pengukuran	33
3.4.2	Skala Pengukuran	34
3.5	Metode Pengumpulan Data	34
3.6	Jenis Data	35
3.7	Populasi dan Sample	35
3.8	Metode Analisis Data	37
BAB IV	ANALISIS HASIL DAN PEMBAHASAN	
4.1	Statistic Deskriptive	43

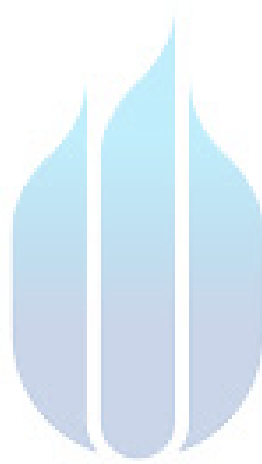
4.2	Uji Normalitas	45
4.3	Uji Asumsi Klasik	
4.3.1	Uji Autokorelasi	48
4.3.2	Uji Heteroskedastisitas	49
4.3.3	Uji Multikolinearitas	50
4.4	Regresi Linier Berganda	51
4.5	Uji Koefisien Determinasi (Uji R ²)	52
4.6	Hipotesis	
4.6.1	Uji Simultan dengan F-test	54
4.6.2	Uji Parsial dengan t-test	55
BAB V	KESIMPULAN	
5.1	Kesimpulan	59
5.2	Saran	60
DAFTAR PUSTAKA	61
LAMPIRAN		

DAFTAR TABEL

Tabel	Halaman
3.1 Daftar sampel Perusahaan LQ-45 2009-2010	36
4.1 Statistik Deskriptive	44
4.2 Uji Normalitas Data Kolmogorov-smirnov	46
4.3 Hasil Uji Autokorelasi	48
4.4 Hasil Uji Multikolonieritas	50
4.5 Hasil Analisis Regresi Linier Berganda	51
4.6 Hasil Uji Koefisien Determinasi	52
4.7 Hasil Uji F	54
4.8 Hasil Uji t	55

DAFTAR GAMBAR

Gambar	Halaman
2.1 Kerangka penelitian	31
2.2 Gambar P.P Plot Normalitas	47
2.3 Gambar P.P Plot Heteroskedasitas	49

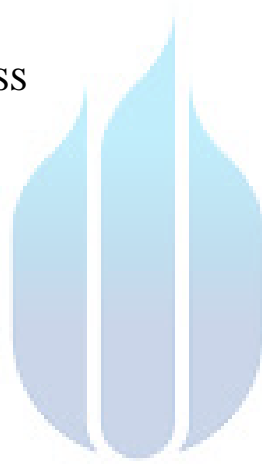


UNIVERSITAS
MERCU BUANA

DATA LAMPIRAN

Lampiran

1. Daftar perusahaan LQ-45 periode Februari 2009-Januari 2010
2. Daftar Perusahaan Outlier
3. Daftar Sampel Perusahaan
4. Data Umur Perusahaan
5. Data Ukuran Perusahaan
6. Data Return Saham
7. Hasil Olah Data SPSS



UNIVERSITAS
MERCU BUANA