

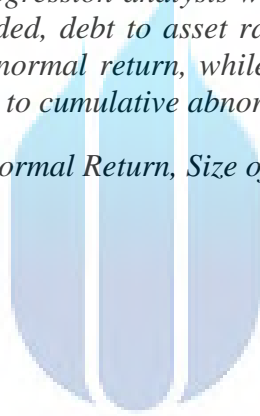
## **ABSTRACT**

*This research to know influence size of firm, return on asset, and debt to asset ratio to cumulative abnormal return at construction and building sector company listed on the Indonesia Stock Exchange (IDX) in 2011 to 2014.*

*This type of research is research into the causal. The population in this research is the construction and building sector company registered in Indonesia Stock Exchange (IDX) in 2011 until 2014. While the sample was determined by the purposive sampling method to obtain a sample of 8 companies as sample.*

*Types of data used is secondary data obtained from [www.idx.co.id](http://www.idx.co.id). The method of analysis used is multiple linear regression analysis. Based on the results of multiple linear regression analysis with a significance level of 5%, the results of the study concluded, debt to asset ratio has a positive and significant influence to cumulative abnormal return, while size of firm and return on asset have insignificant influence to cumulative abnormal return.*

*Keywords: Cumulative Abnormal Return, Size of Firm, Return On Asset, and Debt to Asset Ratio.*



UNIVERSITAS  
MERCU BUANA

## ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh ukuran perusahaan, *return on asset*, dan *debt to asset ratio* terhadap *cumulative abnormal return* pada perusahaan sektor konstruksi dan bangunan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode tahun 2011 sampai dengan tahun 2014.

Penelitian ini tergolong penelitian kausal. Populasi dalam penelitian ini adalah seluruh perusahaan sektor konstruksi dan bangunan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode tahun 2011 sampai dengan tahun 2014. Sedangkan sampel penelitian ini ditentukan dengan metode *purposive sampling* sehingga diperoleh 8 perusahaan sebagai sampel.

Jenis data yang digunakan adalah data sekunder yang diperoleh dari [www.idx.co.id](http://www.idx.co.id). Metode analisis yang digunakan adalah analisis regresi linier berganda. Berdasarkan hasil analisis regresi linier berganda dengan tingkat signifikansi 5%, maka hasil penelitian ini menyimpulkan bahwa *debt to asset ratio* berpengaruh positif signifikan terhadap *cumulative abnormal return*, sedangkan ukuran perusahaan dan *return on asset* tidak berpengaruh signifikan terhadap *cumulative abnormal return*.

Kata kunci : *Cumulative Abnormal Return* , Ukuran Perusahaan, *Return On Asset*, dan *Debt to Asset Ratio*.



UNIVERSITAS  
MERCU BUANA