

ABSTRACT

This research purpose is to examine the influence of The purposes of EVA, MVA, systematic risk, BOPO, LDR, PBV and PER against Stock Return of banking company sector are listing in Indonesia Stock Exchange period 2009 – 2013. Research population the whole company sub sector banks listed on the Indonesia Stock Exchange a number of 36 companies, the sampling technique is purposive sampling with criteria listed for a period of 5 years (2009 to 2013) on the Stock Exchange Indonesia and companies that do not suspended Indonesia Stock Exchange in the period 5 years that found 29 companies sub sector banks to be sampled. The data used are secondary data with the method of analysis used is the analysis of panel data with Pooled Least Square (PLS), Fixed Effect Model (FEM) and Random Effect Model (REM) using EViews. From the analysis output can take summary that variable EVA, MVA, systematic risk, BOPO, LDR, PBV and PER according simultan way is influence and signifikan on stock return, and according partial way only systematic risk, BOPO, LDR, PBV has positive influence and significant on stock return, EVA has negative influence and significant on stock return, MVA dan PER has positive influence and no signifikan on stock return.

Keyword : EVA, MVA, systematic risk, BOPO, LDR, PBV, PER and Stock Return



UNIVERSITAS
MERCU BUANA

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menguji pengaruh EVA, MVA, Risiko Sistematis, BOPO, LDR, PBV dan PER terhadap *Return Saham* pada perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2009 – 2013. Populasi penelitian seluruh perusahaan sub sektor perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia sejumlah 36 perusahaan, teknik pengambilan sampel adalah purposive sampling dengan kriteria terdaftar untuk periode 5 tahun (2009 – 2013) di Bursa Efek Indonesia dan perusahaan yang tidak disuspen Bursa Efek Indonesia pada periode 5 tahun sehingga ditemukan 29 perusahaan sub sektor perbankan untuk dijadikan sampel. Data yang digunakan adalah data sekunder dengan metode *Pooled Least Square (LPS)*, *Fixed Effect Model (FEM)* dan *Random Effect Model (REM)* dengan menggunakan Eviews. Dari hasil analisis dapat ditarik kesimpulan bahwa variabel EVA, MVA, Risiko Sistematis, BOPO, LDR, PBV dan PER secara simultan berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham. Sedangkan secara parsial Risiko Sistematis, BOPO, LDR, PBV berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham, EVA berpengaruh negatif dan signifikan terhadap *Return Saham*, MVA dan PER berpengaruh positif dan tidak signifikan terhadap *Return Saham*.

Kata Kunci: EVA, MVA, Risiko Sistematis, BOPO, LDR, PBV, PER dan *Return Saham*

