

PENGARUH FAKTOR FUNDAMENTAL, RESIKO SISTEMATIS, DAN
DIVIDEND YIELD TERHADAP RETURN SAHAM PADA PERUSAHAAN
MANUFAKTUR YANG TERDAPAT DI BURSA EFEK INDONESIA
(Sub Sektor Industri Barang Konsumsi Pada Tahun 2011-2013)

OLEH :

ALMAYDA KARTIKA

43213110328

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui dan menganalisis pengaruh faktor fundamental (*return on asset*, *debt to equity ratio*, *book value*) resiko sistematis, dan *dividend yield* terhadap return saham pada perusahaan manufaktur sub sektor industri barang konsumsi yang terdapat di Bursa Efek Indonesia periode 2011-2013. Variabel independen yang digunakan dalam penelitian ini adalah faktor fundamental, resiko sistematis dan *dividend yield* sedangkan *return* saham sebagai variabel dependen.

Populasi dalam penelitian ini adalah perusahaan manufaktur yang terdapat di Bursa Efek Indonesia. Teknik pengambilan sampel dalam penelitian ini adalah purposive sampling. Banyaknya sampel yang sesuai dengan kriteria yang ditentukan adalah sebanyak 16 perusahaan.

Berdasarkan hasil penelitian menunjukkan bahwa *return on asset*, *book value* dan *dividend yield* tidak berpengaruh signifikan sedangkan *debt to equity ratio* dan resiko sistematis berpengaruh signifikan terhadap return saham.

Kata kunci : *Return on Asset*, *Debt to Equity Ratio*, *Book Value*, Resiko Sistematis, *Dividen Yield*, dan *Return Saham*.

*THE INFLUENCE OF FUNDAMENTAL FACTOR, SYSTEMATIC RISK, AND
DIVIDEND YIELD TO STOCK RETURNS OF MANUFACTURING
COMPANIES IN THE INDONESIAN STOCK EXCHANGE
(Sub Sector Good Consumer Industry On The Year 2011-2013)*

BY :

ALMAYDA KARTIKA

43213110328

ABSTRACT

This study aims to identify and analyze the influence of fundamental factor (return on asset, debt to equity ratio, book value), systematic risk, and dividend yield of the stock return in manufacturing companies sub sector good consumer industries in Indonesia Stock Exchange 2011-2013. Independent variables used in this study is institutional fundamental factor, systematic risk dividend yield and stock return as the dependent variable.

Population in this research are manufacturing companies in Indonesia Stock Exchange. The sampling technique in this research is purposive sampling. The number of samples in accordance with the prescribed criteria are as many as 16 companies.

Based on the results of the research showed that return on asset, book value and dividend yield does not significantly influence to stovk return but debt to equity ratio and systematic risk significantly influence to stock return.

Keyword : Return on Asset, Debt to Equity Ratio, Book Value, Systematic Risk, Dividend Yield, and Stock Return.