Analisa pengaruh laporan tahunan kinerja emiten terhadap beta saham pada Jakarta islamic index antara 2000-2005

Susilo Dwi Wiyanto, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=95052&lokasi=lokal>

Abstrak

Masalah yang dibahas dalam penelitian ini adalah mengetahui faktor yang paling dominan yang mempengaruhi beta saham pada Jakarta Islamic Index antara tahun 2000-2005 berdasarkan laporan tahunan kinerja emiten yang ada didalamnya. Hal ini dilakukan untuk melihat kontribusi variabel-variabel laporan keuangan seperti devident payout, asset growth, leverage, likuiditas dan total aset sehingga dapat membantu pelaku pasar modal untuk melakukan investasi pada saham-saham syariah.

Metode penelitian yang digunakan adalah dengan mengambil data dari index harga saham JII dan laporan tahunan emiten yang telah diaudit dan dipublikasi secara umum dengan menggunakan analisa regresi berganda.

Hasil dari penelitian ini adalah diketemukan bahwa variable leverage dan likuiditas dapat mempengaruhi beta saham. sedangkan variabel devident layout, asset growth dan total aset tidak berpengaruh signifikan terhadap beta saham. Sedangkan dari hasil pengujian secara simultan terhadap seinua variabel, diketahui bahwa variabel Leverage dan Likuiditas juga sangat berpengaruh terhadap beta saham. Dengan demikian pada kegiatan investasi saham syariah, nilai variabel beta dapat diprediksi melalui perhitungan rasio Leverage dan Likuiditas emiten.