

**KEMENTERIAN RISET, TEKNOLOGI, DAN PENDIDIKAN TINGGI
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS UNIVERSITAS AIRLANGGA**

PROGRAM STUDI : EKONOMI ISLAM

DAFTAR NO:

ABSTRAK

SKRIPSI SARJANA EKONOMI ISLAM

NAMA : MAHENDRA DWI SANTOSO
NIM : 041114069
TAHUN PENYUSUNAN : 2015

JUDUL :
Pengaruh Risiko Sistematis (Beta) dan Likuiditas Saham Terhadap Return Saham Perusahaan Sektor *Basic Industry and Chemicals* yang Terdapat Pada *Jakarta Islamic Index* Tahun 2011-2014

ISI :
Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh risiko sistematis (beta) dan likuiditas saham terhadap return saham perusahaan sektor *basic industry and chemicals* yang terdapat pada *Jakarta Islamic Index* Tahun 2011-2014. Variabel independen risiko sistematis (beta) dan likuiditas saham, metode yang digunakan adalah pendekatan kuantitatif. Teknik analisisnya menggunakan regresi linier berganda dan persamaannya adalah $Y = 0.071 + 0.000 X_1 - 12.050 X_2 +$

Berdasarkan hasil uji t nya, kedua variabel independennya tidak berpengaruh signifikan terhadap variabel dependennya dengan masing-masing hasil uji t -0.016 (X1) dan -0.614 (X2). Hal tersebut juga sejalan dengan hasil uji simultannya yang menghasilkan bahwa kedua variabel independen tidak berpengaruh signifikan terhadap return sahamnya dengan signifikansi sebesar 0.819. Nilai R-Square dalam penelitian ini sebesar 0.9%. Saran untuk para investor yaitu apabila memilih saham untuk portofolio, agar tidak hanya melihat faktor risiko sistematis dan likuiditas saham saja karena sejak krisis 2008, kondisi pasar saham dunia sangat tidak stabil, lebih baik melihat dari sisi analisis fundamental.

Kata kunci : Risiko sistematis, Beta Saham, Likuiditas Saham, Return Saham, *Jakarta Islamic Index*

**MINISTRY OF RESEARCH, TECHNOLOGY, AND HIGHER EDUCATION
FACULTY OF ECONOMIC AND BUSINESS AIRLANGGA UNIVERSITY**

**STUDY : ISLAMIC ECONOMIC
NO LIST :.....**

ABSTRACT

THESIS OF ISLAMIC ECONOMICS BACHELOR

NAME : MAHENDRA DWI SANTOSO
NIM : 041114069
YEARS OF PREPARATION : 2015

TITLE :
Effect of systematic risk and stock liquidity to company stock return sector basic industry and chemicals that listed in jakarta islamic index period 2011-2014

CONTENTS :

The study is aims to understand Effect of systematic risk and stock liquidity to company stock return sector basic industry and chemicals that listed in jakarta islamic index period 2011-2014. The independent variabel is systemic risk and stock liquidity, the method is quantitative. Reseach used multiple regression for analysis with the equation is $Y = 0.071 + 0.000 X_1 - 12.050 X_2 +$

According from the t test result, both independent variabel didn't have an affect signifikanly on dependent variabel with the result of t test for each independent variabel is -0.016 for X1 and -0.614 for X2. The value of R square in this reseach is 0.9%. suggestion for the investor according this reseach is don't buy the stock of company based on this independent variable factor, but based on fundamental factors

Keywords : *Sytemic risk, stock beta, stock liquidity, stock return, Jakarta Islamic Index*

وزاليفعل يلموثق افة

لثقي قق اقبص اد و الأعمال بل جامعة ةي ر لادج

لكلية : القمص اد الإسد .مي

رؤلمتس جيل :

لمخص

بحث ل علمي خري ج القمص اد الإسد لامي

الإسم : ملين درا دوى ستوسو

رقم الطلاب : ٠٤١١١٤٠٩٦

عاطلس جي : ٥٠١٢

لكلمة لثقيسة :

وتبغير المخاطر المتظمة ببيتا (والأرصلقلس بي تل عود ةأس مق طالمقش رك لل صر ناعة الأساسي قوال مو ادلالمق بي قسي جلكت ال مؤشر الإسلامي العام 4100-4102

مخوى :

وتهدف هذه لواس ة ل لقت حدي تبغير المخاطر المتظمة (beta) وبيول ةأس هم طفي الهورص قبي عود القطاعات الأساسي فلصن اعة ولامواد اللحيي بي ة ال وارد قبي لمجارت المؤشر الإسلامي العام 2011-2014. اللخي رات المتنقلة هي المخاطر المتظمة (beta) والأس هلم بيول ة، وطريق ة استخ دام ها موالن هج الكمي. تقوي ات التحليل استخ دام عدة الان حدارال خطي ول معلقة $Y=0.071+0.000 X1- 12.050 X2+e$

بيناء لقي قتلج مش اورنك ه ر الاقبار، وثقبن من اللخي رات المتنقلة لبي سل هتأي ربغير لقي اللخي ل لتبلع مع كل من لتلجبار رل لتلج (X1) -0.016 و (X2) -0.614. وهذا يقق م ر تلج الاخبار قبي وقت وال لتي يتنتج بتغير ين بتق لقي لبي سل هتأي ربغير لقي عود ةأس هم ها مع أهية 0.819 بل غت قبي مة-R اللتي بي قبي هذه لواس ة ل لى .9% ا ترا ح انتللم سبت م ين عن د لتخي ار الأسد هلم مفضطة، ذلك لاترى سوى عوادل المخاطر المتظمة لبيول ة من الأس هم لأن ه من ذ أزم ة عام 4112، ولل ةأس واق الأس هلم قبي العلم غي ر متنقورة لل غلي ة، وربي أفضل من التحليل الأساسي.

لقم اتل بل بحث: مخاطرال فهجي والاس هبيتا، مخزورل بيول ة، عوطد الأسهم، III