

## ABSTRAK

Penelitian ini dimaksudkan untuk menguji determinan resiko sistematis pada sektor *automotive and allied products* di Indonesia, yaitu terdiri dari *Return On Asset (ROA)*, *debt-to-asset ratio*, *assets turn-over*, *quick ratio*, *EBIT growth rate*, dan *market capitalization*. Penelitian ini didasarkan pada penelitian yang dilakukan oleh Rowe dan Kim (2010). Resiko sistematis diukur dengan menggunakan Beta ( $\beta$ ). Sampel yang digunakan dalam penelitian ini adalah 17 perusahaan sektor *automotive and allied products* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) selama periode 2005-2010. Teknik yang digunakan untuk menguji keenam hipotesis adalah regresi linear berganda dengan menggunakan program SPSS 13.0. Hasil penelitian menunjukkan bahwa *ROA*, *debt-to-asset ratio*, dan *market capitalization* berpengaruh positif signifikan terhadap resiko sistematis. Namun, *asset turn-over*, *quick ratio*, dan *EBIT growth rate* tidak berpengaruh terhadap resiko sistematis.

Kata kunci: resiko sistematis, determinan, dan *automotive and allied products*.