

ABSTRAK

NurulUlfahSitiFathonah, **0906459.**
PengaruhProfitabilitasdanNilaiPasarTerhadapReturnSahamPada
Perusahaan SubsektorMakanandanMinuman di Bursa Efek
Indonesia.DosenPembimbing: Prof. Dr. H. DadangSadeli,
M.SidanBudhiPamungkas G, SE. M.Sc.

Salah satu tujuan investor dalam melakukan investasi adalah mendapatkan *return* yang dihasilkan oleh perusahaan. Masalah dalam penelitian ini adalah adanya penurunan harga saham tahun 2007-2012 pada perusahaan subsektor makanan dan minuman, maka tingkat *return* yang dihasilkan pun cenderung menurun. Tujuan dari penelitian ini untuk mengetahui gambaran profitabilitas yang diukur dengan *Return On Equity* (ROE), nilai pasar yang diukur dengan *Price Earning Ratio* (PER) dan *return* saham pada perusahaan subsektor makanan dan minuman di Bursa Efek Indonesia. Serta menguji pengaruh *Return On Equity* (ROE) dan *Price Earning Ratio* (PER) terhadap *return* saham.

Metode penelitian yang digunakan dalam penelitian ini adalah metode deskriptif dan verifikatif. Kemudian teknik analisis yang digunakan adalah Analisis regresi linier berganda, analisis korelasi *product moment*, dan analisis koefisien determinasi. Sedangkan uji hipotesis menggunakan uji F dan uji t. Data yang digunakan adalah data sekunder ROE, PER dan *return* saham perusahaan subsektor makanan dan minuman di Bursa Efek Indonesia dari tahun 2007–2012.

Semua variabel diteliti yaitu ROE dan PER berpengaruh signifikan terhadap *return* saham. Hasil uji simultan (Uji F) menyatakan bahwa ROE dan PER secara bersama-sama berpengaruh signifikan terhadap *return* saham. Nilai dari R^2 adalah 0,182 yang menunjukkan bahwa pengaruh dari ROE dan PER terhadap *return* saham sebesar 18,2%, sedangkan sisanya sebesar 81,8% dipengaruhi oleh variabel lain yang tidak diteliti.

Kata Kunci : Profitabilitas, Nilai Pasar, *Return On Equity*, *Price Earning Ratio*, *Return* Saham.

NURUL ULFAH SITI FATONAH, 2013

Pengaruh profitabilitas dan nilai pasar terhadap return saham pada perusahaan subsektor makanan dan minuman di bursa efek indonesia.

Universitas Pendidikan Indonesia | repository.upi.edu

ABSTRACT

NurulUlfahSitiFathonah, 0906459. The Influences of Profitability and Market Value to the Stock Return on Food and Beverage Subsector Companies In Indonesia Stock Exchange. Under the guidance of Prof. Dr. H. DadangSadeli, M.SidanBudhiPamungkas G, SE. M.Sc.

A shareholder purpose in investment to gain the return which is earned by the company. The phenomena on this research is the decline of stock price food and beverage subsector during 2007-2012. So that, the stock return was earned by food and beverage subsector during 2007-2012 inclining decline. The research purposes to know profitability description is measured by Return On Equity (ROE), market value by Price Earning Ratio (PER) and stock return on food and beverage subsector companies in Indonesia Stock Exchange. Beside that, to determine the influence of Return on Equity (ROE) and Price Earning Ratio (PER) to stock return

The research method used descriptive method and verification method. And analysis technique which used is double linier regression analysis, product moment correlation and determination coefficient analysis. Meanwhile, the hypotheses test used F-test and T-test. Data which used is secondary data ROE, PER and stock return on food and beverage subsector companies in Indonesia Stock Exchange during 2007 – 2012.

ROE and PER are significant to the stock return. According to simultaneous test (F-test) showed that ROE and PER jointly influenced significantly to the stock return. The value of R^2 is 0,182 showed that the influences of ROE and PER to the stock return as much 18,2% while other remaining as much 81,8% is influenced by other variables.

Keywords: Profitability, Market Value, Return OnEquity, Price Earning Ratio, Stock Return.

NURUL ULFAH SITI FATONAH, 2013

Pengaruh profitabilitas dan nilai pasar terhadap return saham pada perusahaan subsektor makanan dan minuman di bursa efek indonesia.

Universitas Pendidikan Indonesia | repository.upi.edu