

Pengaruh *Return On Investment*, Rasio Aktivitas, Rasio Pasar, Suku Bunga, Nilai tukar, Ukuran Perusahaan Terhadap *Return Saham* Pada Perusahaan Pertambangan Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Periode 2013-2016

Oleh:

Syahrul Anam Perdana Putra
Jurusan Akuntansi Fakultas Ekonomi dan Bisnis UPN “Veteran” Yogyakarta

ABSTRAKSI

Tujuan dalam penelitian ini untuk mengetahui pengaruh *return on investment*, rasio aktivitas, rasio pasar, suku bunga, nilai tukar, dan ukuran perusahaan terhadap *return* saham. Populasi yang digunakan adalah perusahaan pertambangan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia pada periode 2013-2016. Dalam teknik pengambilan sampel penelitian ini menggunakan metode *purposive sampling*, yaitu teknik pengambilan sampel berdasarkan kriteria yang telah ditentukan, sehingga total observasi yang terdapat dalam penelitian ini berjumlah 56 observasi. Model analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah Analisis Deskriptif dan Analisis Regresi Linier Berganda.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa *return on investment* dan rasio pasar berpengaruh positif terhadap *return* saham, rasio aktivitas berpengaruh negatif terhadap *return* saham sedangkan suku bunga, nilai tukar, dan ukuran perusahaan tidak berpengaruh terhadap *return* saham pada perusahaan pertambangan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia.

Kata Kunci: *Return saham, return on investment, rasio pasar, rasio aktivitas, suku bunga, nilai tukar, dan ukuran perusahaan*

Pengaruh *Return On Investment*, Rasio Aktivitas, Rasio Pasar, Suku Bunga, Nilai tukar, Ukuran Perusahaan Terhadap *Return Saham* Pada Perusahaan Pertambangan Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Periode 2013-2016

Oleh:

Syahrul Anam Perdana Putra

Jurusan Akuntansi Fakultas Ekonomi dan Bisnis UPN “Veteran” Yogyakarta

Abstract

The purpose of this research is to know the effect of return on investment, activity ratio, market ratio, interest rate, exchange rate, and firm size to stock return. The population used is a mining company listed on the Indonesia Stock Exchange in the period 2013-2016. In sampling technique this research use purposive sampling method, that is sampling technique based on predetermined criteria, so total observation in this research is 56 observation. The analysis model used in this research is Descriptive Analysis and Multiple Linear Regression Analysis.

The results of this study indicate that the return on investment and market ratios have a positive effect on stock returns, activity ratios have a negative effect on stock returns, while interest rates, exchange rates, and firm size have no effect on stock returns on mining companies listed on the Indonesia Stock Exchange.

Keywords: Return on stock, return on investment, market ratio, activity ratio, interest rate, exchange rate, and firm size