

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis dan mengetahui pengaruh net profit margin, price book value, leverage, volume perdagangan, tingkat suku bunga terhadap beta saham. Data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data presentase bulanan sedangkan data beta saham adalah satuan beta saham bulanan perusahaan sampel di JII. Data yang digunakan periode Januari 2010-Desember 2013 dan diambil dari Bank Indonesia, www.idx.co.id, dan situs atau sumber lain yang relevan. Hasil penelitian ternyata semua fariabel yaitu net profit margin, price book value, leverage, volume perdagangan, tingkat suku bunga tidak berpengaruh signifikan terhadap beta saham syariah. Hasil penelitian ini berlaku untuk periode penelitian yang bersangkutan untuk menegtahui apakah hasil penelitian ini berlaku secara umum perlu dilakukan penelitian sejenis dengan menggunakan periode yang lain.

Kata kunci: net profit margin, price book value, leverage, volume perdagangan, tingkat suku bunga.

ABSTRACT

This study aims to analyze and determine the effect net profit margin , price book value , leverage , trading volume , interest rate against beta stocks. The data used in this study is the monthly percentage of data while the data stock beta is a beta unit monthly stock companies sampled in JII . The data used in the period January 2010 - December 2013 and taken from Bank Indonesia , www.idx.co.id , and sites or other relevant sources . Results of the study was all fariabel ie net profit margin , price book value , leverage , trading volume , interest rates did not significantly influence the stock beta sharia . Results of this study apply to the period in question to menegtahui study whether these results apply generally similar studies need to be done using another period .

Keywords : net profit margin , price book value , leverage , trading volume , interest rate