

ABSTRAK

PENGARUH RISIKO SAHAM DAN UKURAN PERUSAHAAN TERHADAP *RETURN* SAHAM

Studi Empiris di Bursa Efek Jakarta

A. Henriyanto

Universitas Sanata Dharma

Yogyakarta

2005

Tujuan penelitian ini adalah: 1) untuk mengetahui apakah risiko saham berpengaruh terhadap *return* saham yang diperdagangkan di Bursa Efek Jakarta, 2) untuk mengetahui apakah ukuran perusahaan berpengaruh terhadap *return* saham yang diperdagangkan di Bursa Efek Jakarta.

Teknik pengumpulan data dilakukan dengan teknik dokumentasi. Data yang digunakan adalah pertama, data harga pasar saham setiap akhir bulan dari 31 Desember 2002 sampai dengan 31 Desember 2004 yang termasuk dalam *50 most active stocks*. Kedua, data *return* pasar (IHSG) setiap akhir bulan dari 31 Desember 2002 sampai dengan 31 Desember 2004.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa: 1) Risiko saham berpengaruh secara signifikan terhadap *return* saham, 2) ukuran perusahaan tidak berpengaruh secara signifikan terhadap *return* saham.

ABSTRACT

The INFLUENCE of RISK and FIRM SIZE to STOCK RETURN

A. Henriyanto

Universitas Sanata Dharma

Yogyakarta

This research were aimed 1) to identity the influence of risk to stock return of stock listed on Jakarta Stock Exchange, 2) to identity the influence of firm size to stock return of stock listed on Jakarta Stock Exchange.

The data collecting method conducted by the documentation method. The data colected were monthly market price from 31 December 2002 up to 31 December 2004 which is the included in 50 most active stocks, monthly return market (IHSG) from 31 December 2002 up to 31 December 2004.

The result of the research showed that 1) stock risk have significantly affect to return stock, 2) firm size have not significantly affect to return share.