

ABSTRAK

ANALISIS HUBUNGAN ANTARA RESIKO TOTAL DENGAN TINGKAT KEUNTUNGAN SAHAM

Studi Kasus pada saham – saham LQ45 Di Bursa Efek Jakarta

Andreas Yandy Prasetyo

Universitas Sanata Dharma

Yogyakarta

2007

Tujuan penelitian ini adalah untuk mengetahui ada atau tidaknya hubungan antara resiko total dengan tingkat keuntungan saham, serta signifikan atau tidaknya hubungan tersebut bila ada. Teknik pengumpulan data dilakukan dengan teknik dokumentasi.

Teknik pengambilan sampel berdasarkan 45 saham yang termasuk dalam indeks LQ45. teknik analisis data yang dipergunakan adalah metode regresi linier sederhana, standar deviasi, serta korelasi.

Hasil penelitian , dari 45 saham yang termasuk dalam LQ45 tanggal 2 Februari 2005, setelah dihitung *closed price* masing – masing selama 201 hari, sebanyak 25 saham mengalami keuntungan yang positif, sedangkan 20 saham sisanya mengalami keuntungan yang negatif. Penghitungan korelasi antara resiko total dengan tingkat keuntungan saham mencatat angka sebesar 0,445703969,. Ini dapat dikatakan bahwa ada hubungan yang cukup kuat antara resiko total dengan tingkat keuntungan saham. Dengan uji t didapatkan hasil t hitung sebesar 3,264902062, sedangkan t tabel sebesar 1,681. Dengan demikian, t hitung lebih besar daripada t tabel, maka hubungan antara resiko total dengan tingkat keuntungan saham signifikan.

ABSTRACT

ANALYSIS OF RELATIONSHIP BETWEEN TOTAL RISK AND STOCK RETURN

Case Study in LQ45's Stock of Jakarta Stock Exchange

Andreas Yandy Prasetyo

Sanata Dharma University

2007

The objectives of the research was to identify the relationship between total risk and stock return. Technique of collecting data was documentation. Technique of data analysis used in the research were simple regression, standart deviation, and correlation analysis.

The result of the research indicated that the correlation coeffisient between total risk and stock return was 0,445703969. Based on t-test, it could be concluded that the relationship between total risk and stock return was significant.