

ABSTRAK

PENGARUH RETURN PASAR TERHADAP RETURN SAHAM SAHAM INDUSTRI BARANG KONSUMSI DENGAN MENGGUNAKAN CAPITAL ASSET PRICING MODEL Studi Empiris pada Bursa Efek Jakarta

**Shelfordy
(012114129)
Universitas Sanata Dharma
Yogyakarta
2005**

Tujuan penelitian ini adalah untuk mendapatkan bukti empiris tentang pengaruh *return* pasar terhadap *return* saham-saham Industri Barang Konsumsi dengan menggunakan *Capital Asset Pricing Model*. Penelitian ini dilakukan untuk tahun 2003.

Teknik pengambilan sampel dilakukan dengan *purposive sampling* yaitu sebanyak 32 saham yang aktif selama tahun 2003. Teknik analisis data yang digunakan adalah metode regresi linear sederhana.

Hasil penelitian dari 32 saham adalah bahwa sebanyak 22 saham (68,75% dari total sampel yang diteliti) menunjukkan *return* pasar berpengaruh secara signifikan terhadap *return* saham Industri Barang Konsumsi. Sedangkan sebanyak 10 saham lainnya menunjukkan *return* pasar tidak berpengaruh secara signifikan terhadap *return* saham Industri Barang Konsumsi (31,25% dari total sampel yang diteliti).

ABSTRACT

The Influence of Market Return Towards The Share Return of Consumer Goods Industry Using Capital Asset Pricing Model An Empirical Study at Jakarta Stock Exchange

**Shelfordy
(012114129)
Sanata Dharma University
Yogyakarta
2005**

The aimed of this research was to obtain empirical evidence of the influence of market return towards the share return of Consumer Goods Industry using capital asset pricing model in 2003.

This research took thirty two traded shares in activees during 2003 which taken using purposive sampling method. The data analysis technique was simple linear regression model.

The result of the research found that there were 22 shares (68,75%) which showed that the market return had positive influence towards the industry return and 10 shares (31,25%) which showed that the market return had not positive influence towards the industry return.