

## **Abstrak**

### **PENGARUH TINGKAT KEUNTUNGAN PASAR TERHADAP TINGKAT KEUNTUNGAN SAHAM**

Studi Empiris pada Perusahaan yang Terdaftar di Bursa Efek Jakarta tahun 2003

Caecilia Henny Setya Wati  
982114172  
Universitas Sanata Dharma  
Yogyakarta  
2005

Tujuan penelitian ini adalah untuk mengetahui pengaruh tingkat keuntungan pasar terhadap tingkat keuntungan saham. Pengumpulan data dilakukan dengan cara pencatatan terhadap data yang sudah dipublikasikan oleh bursa Efek Jakarta. Teknik pengambilan sampel dilakukan dengan *convenience sampling* sebanyak 37 perusahaan. Teknik analisis data yang digunakan adalah metode regresi linier sederhana.

Hasil analisis data menunjukkan bahwa uji hipotesis terhadap 37 sampel dapat disimpulkan bahwa  $H_0$  ditolak untuk 13 sampel yang berarti tingkat keuntungan pasar berpengaruh secara signifikan terhadap tingkat keuntungan saham dan  $H_0$  diterima untuk 24 sampel, artinya bahwa tingkat keuntungan pasar tidak berpengaruh secara signifikan terhadap tingkat keuntungan saham.

## **Abstract**

### **THE INFLUENCE OF MARKET RETURN LEVEL ON STOCK RETURN LEVEL**

An Empirical Study of Listed Companies at Jakarta Stock Exchange in 2003

Caecilia Henny Setya Wati  
982114172  
Sanata Dharma University  
Yogyakarta  
2005

The purpose stock of this research was to know the influence of market return level on stock return level. The data collection technique was done by recording the data which had been published by the Jakarta stock exchange. The sampling techique was convenience sampling for 37 companies. Moreover, the data analysis techique used waas simple linier regrssion method.

The data analysis result showed that from the hypothesis test on 37 samples it coud be concluded that  $H_0$  was rejected for 13 samples. It meant that market rturn level influenced significantly on the level of stock return. Furthermore,  $H_0$  was accepted for 24 samples. It meant that market return level did not influence significantly on stock level.