

ABSTRAK

IMPLIKASI KOMPONEN LAPORAN ARUS KAS, LABA KOTOR, DAN SIZE PERUSAHAAN TERHADAP *EXPECTED RETURN* SAHAM (Studi Pada Perusahaan yang Terdaftar di *Jakarta Islamic Index* Periode 2011-2013)

Oleh

SENDY OCTIANTI AZRIL

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui pengaruh komponen laporan arus kas, laba kotor dan *size* perusahaan terhadap *expected return* saham pada perusahaan *Jakarta Islamic Index* periode tahun 2011-2013. Jenis penelitian yang digunakan adalah eksplanatori, yaitu untuk menguji hipotesis. Teknik pengambilan sampel menggunakan *purposive sampling*. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa nilai korelasi menunjukkan hubungan antar variabel adalah dalam kategori cukup lemah, pada uji pengaruh komponen laporan arus kas terhadap *expected return* saham secara parsial berpengaruh signifikan terhadap *expected return* saham dengan ketiganya memiliki hubungan yang positif. *Size* perusahaan terhadap *expected return* saham secara parsial berpengaruh signifikan dimana *size* perusahaan memiliki hubungan yang negative. Sedangkan laba kotor secara parsial berpengaruh tidak signifikan terhadap *expected return* saham dimana laba kotor memiliki hubungan yang negatif. Dan. Secara simultan komponen laporan arus kas, laba kotor dan *size* perusahaan menunjukkan pengaruh yang signifikan terhadap *expected return* saham.

Kata Kunci: Komponen Laporan Arus Kas, Laba Kotor, *Size* Perusahaan dan *Expected Return* Saham