

ABSTRAK

ANALISIS PENGARUH FAKTOR FUNDAMENTAL TERHADAP RETURN SAHAM PERUSAHAAN PADA PERUSAHAAN PROPERTI YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK INDONESIA

Oleh

ANNISA DIANDRA

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh faktor fundamental terhadap *return* saham pada perusahaan property yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. *Return* saham adalah sejumlah dana yang akan diterima oleh investor sesuai dengan jumlah dana yang diinvestasikan. Hipotesis dalam penelitian ini adalah faktor fundamental (rasio likuiditas, rasio profitabilitas, rasio solvabilitas) memiliki pengaruh yang signifikan terhadap *return* saham baik secara parsial maupun secara simultan.

Penelitian ini menggunakan metode kuantitatif, dengan data sekunder yang diperoleh dari Bursa Efek Indonesia. Sampel penelitian dipilih dengan teknik *purposive sampling* dan diperoleh 10 sampel perusahaan yang *listing* pada tahun 2000 - 2007. Metode analisis data dilakukan dengan menggunakan uji regresi berganda untuk mengetahui pengaruh faktor fundamental terhadap *return* saham.

Hasil penelitian ini menyatakan bahwa ketika diuji secara parsial rasio likuiditas dan profitabilitas berpengaruh signifikan terhadap *return* saham sedangkan rasio solvabilitas tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham. Ketika diuji secara simultan rasio likuiditas, profitabilitas dan solvabilitas berpengaruh signifikan terhadap *return* saham

Kata Kunci : Faktor Fundamental, *Return* Saham.