

## ABSTRAK

### **FAKTOR-FAKTOR YANG MEMPENGARUHI RETURN SAHAM Studi Kasus Pada: Industri makanan dan minuman yang *Go Public* di Bursa Efek Indonesia.**

**Lukas Wiyatno  
Universitas Sanata Dharma  
Yogyakarta  
2010**

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui faktor-faktor yang mempengaruhi *return* saham pada industri makanan dan minuman yang *go public* di Bursa Efek Indonesia. Penelitian ini dilakukan selama bulan Mei tahun 2010 di Pojok Bursa Efek Indonesia Universitas Sanata Dharma. Penelitian ini dilakukan pada 17 perusahaan makanan dan minuman yang telah terdaftar di Bursa Efek Indonesia selama periode tahun 2004 sampai dengan tahun 2008. Pengumpulan data dilakukan dengan teknik dokumentasi yaitu dengan cara mencatat data yang tercantum pada *Indonesian Capital Market Directory*. Teknik analisis data yang digunakan adalah analisis regresi berganda. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa secara bersama-sama variabel *debt to equity ratio*, *systematic risk*, *earning per share* dan *price earning ratio* berpengaruh terhadap *return* saham. Secara parsial variabel *debt to equity ratio*, *systematic risk* dan *earning per share* berpengaruh terhadap *return* saham, sedangkan *price earning ratio* tidak berpengaruh terhadap *return* saham.

**ABSTRACT**  
**SOME FACTORS INFLUENCING STOCK RETURN**  
**A Case Study at food and beverage industries listed at Indonesian Stock Exchange**

**Lukas Wiyatno**  
**Sanata Dharma University**  
**Yogyakarta**  
**2010**

This research was aimed to know some factors that influenced the stock return at food and beverage industries listed at Indonesian Stock Exchange. This research was conducted in May 2010 at Indonesian Stock Exchange corner Sanata Dharma University. This research was done on 17 food and beverage companies registered in Indonesian Stock Exchange from 2004 to 2008. The data collection was done using documentary technique which was made by recording data published at Indonesian Capital Market Directory. The data analysis technique used in conducting this research was multiple regression analysis. The result of this research showed that simultaneously the variable of debt to equity ratio, systematic risk, earning per share and price earning ratio influenced the stock return. Partially the variable of the debt to equity ratio, systematic risk, earning per share influenced the stock return, whereas the price earning ratio did not influence the stock return.