

ABSTRAK

**Sekolah Pascasarjana
Program Studi Magister Manajemen S-2
2018**

**Suci Lestari
2102016011**

**Pengaruh Faktor Fundamental terhadap Beta Saham Syariah di Bursa Efek
Indonesia**

99+xiii halaman, 18 tabel, 5 gambar, 8 lampiran

Uraian Abstrak

Penelitian ini menganalisis pengaruh faktor fundamental terhadap beta saham. Sampel penelitian ini adalah perusahaan yang tercatat dalam Indeks Saham Syariah Indonesia periode 2017-2018. Terdapat lima variabel yang digunakan yaitu: beta saham sebagai variabel terikat dan PBV, DER, ROE, TATO dan CR sebagai variabel bebas. Penelitian ini menggunakan model regresi linier berganda. Hasil penelitian ini menyimpulkan bahwa variabel yang berpengaruh positif signifikan terhadap beta saham adalah PBV dan DER, hanya ROE yang berpengaruh negative signifikan. Sedangkan variabel yang tidak berpengaruh terhadap beta saham adalah TATO dan CR.

Kata Kunci: PBV, DER, ROE, TATO, CR dan Beta Saham