

ABSTRAK

Fakultas Ekonomi

Program Studi S-1 Manajemen

2017

Mawaddah Oktatari Hidayani

120.2013.076

Pengaruh Beta Saham, Ukuran Perusahaan, *Total Asset Turn Over* dan Suku Bunga Acuan Terhadap *Return Saham* Pada Perusahaan *Non Financial* dalam Indeks LQ45 yang tercatat di Bursa Efek Indonesia dan Ditinjau Dari Sudut Pandang Islam.

104 + xiv halaman, 12 tabel, 7 gambar, dan 18 lampiran

Tujuan penelitian ini adalah untuk menganalisis Beta Saham, Ukuran Perusahaan, *Total Asset Turn Over*, dan Suku Bunga terhadap *Return Saham* Indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia periode 2011-2015. Penelitian ini menggunakan data Sekunder yang diperoleh dari Laporan Keuangan Triwulan Perusahaan yang termasuk Indeks LQ45 periode 2011-2015 yang diunduh dari *website* resmi Bursa Efek Indonesia dan *Indonesia Capital Market Directory (ICMD)*. Sampel diambil dengan menggunakan metode *purposive sampling*. Berdasarkan Kriteria yang telah ditentukan, sampel pada penelitian ini terdiri dari 13 perusahaan yang termasuk kedalam Indeks LQ45. Metode analisis data yang digunakan adalah Analisis Regresi Berganda dengan taraf signifikansi 0,05. Berdasarkan hasil penelitian menunjukkan bahwa variabel Beta Saham dan Ukuran Perusahaan berpengaruh positif dan signifikan terhadap *Return Saham*. Sedangkan *Total Asset Turn Over*, dan Suku Bunga berpengaruh negatif dan signifikan terhadap *Return Saham*.

Kata Kunci : Beta Saham, Ukuran Perusahaan, *Total Asset Turn Over (TATO)*, Suku Bunga Acuan, dan *Return Saham*.