

Analisis pengaruh variabel makro ekonomi terhadap return indeks saham sektor perbankan periode 2002-2011 serta pengaruh karakteristik bank terhadap profitabilitas perusahaan sektor perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2007-2011 = Influence analysis of macro economics on banking return index during period 2002-2011 and influence of bank specific on profitability of banking sector listed on Indonesian Stock Exchange during period 2007-2011

Dessy Ayu Saputri, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20329803&lokasi=lokal>

Abstrak

Penelitian ini bertujuan untuk melihat apakah terdapat pengaruh antara variabel makro ekonomi yaitu GDP, Inflasi, dan tingkat suku bunga SBI terhadap return indeks saham, ROA rata-rata, dan ROE rata-rata sektor perbankan, serta pengaruh variabel karakteristik bank seperti total aset, rasio CAR, dan rasio manajemen aset terhadap profitabilitas sektor perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Uji hipotesis dari penelitian ini menggunakan regresi linear berganda dengan periode observasi triwulan dari tahun 2002-2011 untuk model 1, serta tahunan dari tahun 2007-2011 untuk model 2 terhadap 25 perusahaan sektor perbankan yang terdaftar di Bursa Efek.

Dari hasil penelitian diperoleh kesimpulan bahwa untuk model 1, variabel makro ekonomi secara parsial tidak mempunyai pengaruh signifikan terhadap return indeks saham, namun variabel SBI dan inflasi secara parsial mempunyai pengaruh secara signifikan terhadap pergerakan nilai ROA rata-rata dan ROE rata-rata sektor perbankan, Untuk model 2, hanya variabel total aset secara parsial mempunyai pengaruh signifikan terhadap profitabilitas perusahaan sektor perbankan.

.....This research aim to prove if there is any effect from the change of macro economic variables, such as GDP, Inflation, and interest rate on banking index return, average ROA and average ROE. And also to prove the change of bank spesific, such as total asset, CAR, and asset management to the profitability of banking sector listed on Indonesian Stock Exchange. Hypothesis of this research is tested using multiple regression linear with quarterly observation periode during year 2002-2011 for model 1, and annually observation period during year 2007-2011 for model 2, towards 25 banking sector listed on Indonesian Stock Exchange. From the research, we concluded that for model 1, all of these macro economic variables partially does not have a significant effect on banking index return, but SBI and inflation variables does have a significant effect on average ROA and average ROE. For model 2, only total asset variables that partially have a significant effect on profitability of banking sector.