

Pengaruh karakteristik fundamental perusahaan terhadap return saham individual dan portofolio pada perusahaan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2010-2016 = The effect of firm fundamental characteristics on individual stock return and portfolio return for firms listed on Indonesia stock exchange 2010-2016

Indira Permata Adha, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20466123&lokasi=lokal>

Abstrak

ABSTRAK

Penelitian ini menguji pengaruh karakteristik fundamental perusahaan terhadap return saham individual maupun return portofolio pada perusahaan-perusahaan di Indonesia. Sampel yang digunakan adalah perusahaan yang tercatat di Bursa Efek Indonesia sejak periode tahun 2010 sampai 2016. Berdasarkan hasil model regresi, terdapat pengaruh antara size, market-to-book, price-to-earning, price-to-sales, dan leverage sebagai karakteristik fundamental perusahaan terhadap return saham individual dan return portofolio. Tidak ditemukan size effect di Indonesia dan market-to-book merupakan faktor yang memiliki pengaruh terkuat dibandingkan dengan variabel lainnya dalam penelitian ini.

ABSTRACT

This study examines the effect of firm fundamental characteristics on individual stock return and portfolio return in Indonesia. The sample used on this study is all of the companies listed on Indonesia Stock Exchange during 2010 until 2016. Based on the results of the regression model, individual stock return and portfolio return found to be determined by size, market to book, price to earning, price to sales and leverage. There is no size effect in Indonesia and market to book seems to be the strongest relation with stocks returns when compared to other variables examined.