

ABSTRAK

Muhamad Nurhidayat, 1950110133, judul skripsi “Return On Asset dan Resiko Sistematis Terhadap Harga Saham Sektor Pertambangan Di Jakarta Islamic Index (JII) Pada Tahun 2018-2021”

Penelitian ini memiliki tujuan untuk dapat mengetahui hubungan dan pengaruh dari return on asset (ROA) dan risiko sistematis terhadap harga saham sektor pertambangan di JII (Jakarta Islamic Index). Saham dari sektor pertambangan juga termasuk kedalam bagian dari saham *blue-chip* yang dikenal sebagai saham yang memiliki fundamental yang baik dan harga yang relatif stabil. Tetapi IHSG mengalami pergejolakan harga ketika pandemi covid 19, selain itu pengesahan UU minerba juga mendorong terjadinya perubahan pada harga saham pada sektor pertambangan. Metode penelitian yang digunakan yakni metode kuantitatif dengan model pendekatan deskriptif. Sampel penelitian sebanyak 11 perusahaan pertambangan dengan waktu pengamatan 4 tahun. Dalam melakukan analisis pada data dilakukan dengan menggunakan model regresi linier berganda. Hasil penelitian ini memberikan kesimpulan bahwa variabel return on asset (ROA) berpengaruh secara signifikan terhadap harga saham pertambangan di JII, dengan nilai t hitung 3,032 yang lebih besar dari t tabel dengan nilai 2,01954 dengan nilai signifikansi 0,004 lebih kecil dari 0,05. Variabel risiko sistematis tidak berpengaruh signifikan terhadap harga saham di JII, dengan nilai t hitung -1,964 lebih kecil dari t tabel yang bernilai 2,01954 dengan nilai signifikansi 0,054 lebih besar dari 0,05. Tetapi secara bersamaan atau simultan, kedua variabel memiliki pengaruh terhadap harga saham pertambangan di JII, dengan nilai f hitung 6,077 lebih besar dari f tabel yang sejumlah 3,23 dengan memiliki nilai signifikansi 0,005 yang lebih kecil dari 0,05.

Kata kunci: Return on Asset (ROA), Resiko Sistematis, Saham Syariah, Jakarta Islamic Index, Harga Saham.

ABSTRAK

This study aims to determine the relationship and influence of return on assets (ROA) and systematic risk on mining sector stock prices in JII (Jakarta Islamic Index). Stocks from the mining sector are also part of the blue-chip stocks which are known as stocks that have good fundamentals and relatively stable prices. However, the IHSG experienced price fluctuations during the Covid 19 pandemic. In addition, the ratification of the Minerba Law also prompted changes in share prices in the mining sector. The research method used is a quantitative method with a descriptive approach model. The research sample consisted of 11 mining companies with an observation period of 4 years. In conducting the analysis on the data is done by using a multiple linear regression model. The results of this study conclude that the variable return on assets (ROA) has a significant effect on mining stock prices in JII, with a t-count value of 3,032 which is greater than t-table with a value of 2,01954 with a significance value of 0,004 which is less than 0,05. Systematic risk variables have no significant effect on stock prices in JII, with a t-value of -1,964 which is less than t-table which is 2,01954 with a significance value of 0,054 greater than 0,05. But simultaneously or simultaneously, the two variables have an influence on mining stock prices in JII, with a calculated f value of 6,077 greater than the f table which is 3,23 with a significance value of 0,005 which is smaller than 0,05.

Keyword: Return on asset (ROA), Systematic Risk, Stock Price, Sharia Stock, Jakarta Islamic Index.