

INTISARI

Studi ini meneliti tentang analisis pengaruh rasio keuangan terhadap beta saham perusahaan manufaktur yang tercatat di Bursa Efek Jakarta. Periode yang digunakan dalam penelitian ini adalah selama satu tahun yaitu tahun 2003, Uji analisis statistik yang digunakan adalah dengan menggunakan analisis regresi linier berganda.

Data yang diambil dalam penelitian ini terdiri dari 42 perusahaan industri manufaktur yang dipilih secara *purposive sampling*. Hasil analisis data terhadap 42 perusahaan manufaktur di Bursa Efek Jakarta menunjukkan bahwa, secara bersama-sama rasio keuangan yang terdiri dari *Price Earning Ratio* (PER), *Leverage Ratio* (LVG), *Current Ratio* (CR), dan *Net Profit Margin* (NPM), memiliki pengaruh yg signifikan terhadap beta saham, Sedangkan secara parsial maka hanya *Price Earning Ratio* (PER) yang memiliki pengaruh yang signifikan terhadap beta saham.

Kata kunci : Beta saham, *Price Earning Ratio*, *Leverage Ratio*, *Net Profit*

ABSTRACT

This research studied about analysis of effect for financial ratio on beta share of manufacturing firm listed in Jakarta Stock Exchange. Periode used in this research was a year over 2003. Statistical analysis test used was multiple linier regression analysis.

Data gathered in this research consisted of 42 firms of manufacturing industry with purposive sampling. Result of data analysis on 42 manufacturing firms in Jakarta Stock Exchange showed that simultaneously financial ratio including Price Earning Ratio (PER), Leverage Ratio (LVG), Current Ratio (CR), and Net Profit Margin (NPM), had significant influence on beta share, while partially Price Earning Ratio (PER) had significant influence on beta share.

Keywords: beta share, Price Earning Ratio, Leverage Ratio, Net Profit Margin