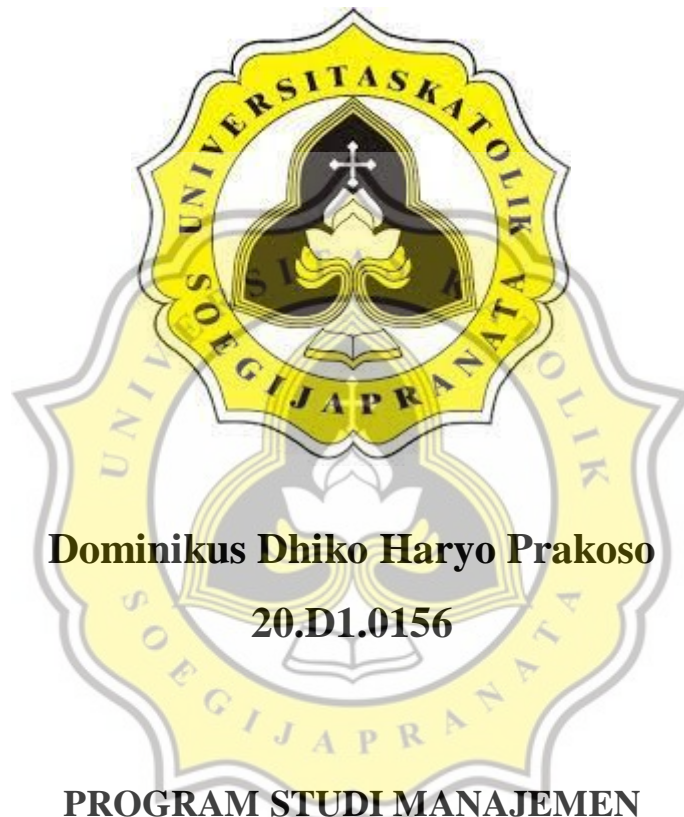


**PENGARUH DER, DOL, EPS, UKURAN PERUSAHAAN, ROA DAN CR
TERHADAP RISIKO SISTEMATIK (BETA SAHAM) PERUSAHAAN
PERTAMBANGAN YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK INDONESIA
PERIODE 2013-2017**

SKRIPSI



Dominikus Dhiko Haryo Prakoso

20.D1.0156

**PROGRAM STUDI MANAJEMEN
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS
UNIVERSITAS KATOLIK SOEGIJAPRANATA
SEMARANG
2021**



**PENGARUH DER, DOL, EPS, UKURAN PERUSAHAAN, ROA DAN CR
TERHADAP RISIKO SISTEMATIK (BETA SAHAM) PERUSAHAAN
PERTAMBANGAN YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK INDONESIA
PERIODE 2013-2017**

SKRIPSI

**Diajukan dalam Rangka Memenuhi
Salah Satu Syarat Memperoleh
Gelar Sarjana Manajemen**



Dominikus Dhiko Haryo Prakoso

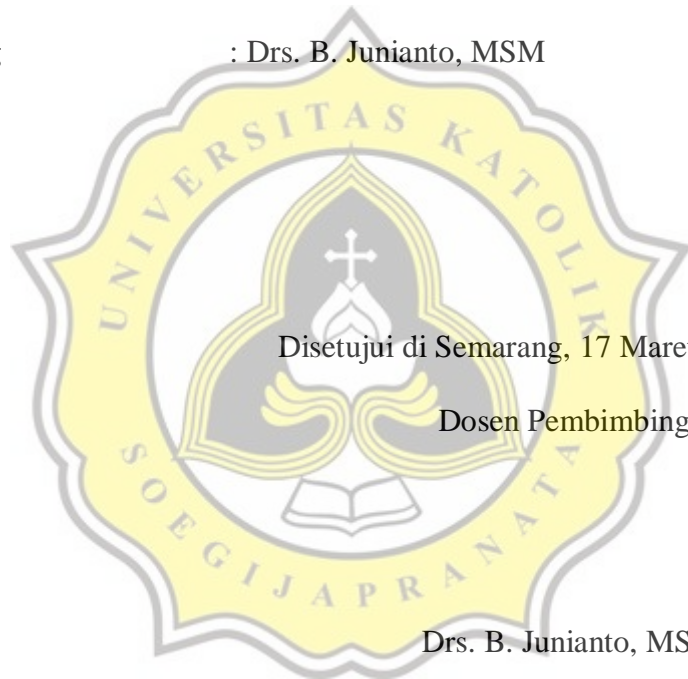
20.D1.0156

**PROGRAM STUDI MANAJEMEN
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS
UNIVERSITAS KATOLIK SOEGIJAPRANATA
SEMARANG**

2021

HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI

Nama : Dominikus Dhiko Haryo Prakoso
Nomor Induk Mahasiswa : 20.D1.0156
Fakultas : Ekonomi dan Bisnis
Judul : “Pengaruh DER, DOL, EPS, Ukuran Perusahaan, ROA dan CR terhadap Risiko Sistemik (Beta Saham) Perusahaan Pertambangan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2013-2017”
Dosen Pembimbing : Drs. B. Junianto, MSM



Disetujui di Semarang, 17 Maret 2021

Dosen Pembimbing,

Drs. B. Junianto, MSM

PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI

Yang bertanda tangan di bawah ini :

Nama : **Dominikus Dhiko Haryo Prakoso**

NIM : **20.D1.0156**

Jurusan : **Manajemen**

Fakultas : **Ekonomi dan Bisnis**

Menyatakan bahwa skripsi dengan judul: **“PENGARUH DER, DOL, EPS, UKURAN PERUSAHAAN, ROE DAN CR TERHADAP RISIKO SISTEMATIK (BETA SAHAM) PERUSAHAAN PERTAMBANGAN YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK INDONESIA PERIODE 2013-2017”** adalah karya saya. Dengan ini saya menyatakan dengan sesungguhnya bahwa dalam Skripsi ini tidak terdapat keseluruhan atau sebagian tulisan orang lain yang saya ambil dengan cara mengambil atau meniru kalimat atau simbol yang menunjukkan gagasan atau pendapat atau pemikiran dari penulis lain, yang saya akui seolah-olah sebagai tulisan saya sendiri, dan atau tidak terdapat bagian atau keseluruhan tulisan yang saya salin, tiru atau yang saya ambil dari tulisan orang lain tanpa memberikan pengakuan pada penulis aslinya.

Saya bersedia menarik skripsi yang saya ajukan, apabila terbukti bahwa saya melakukan tindakan menyalin atau meniru tulisan orang lain yang seolah-olah tulisan saya sendiri. Saya bersedia bila gelar dan ijazah yang diberikan oleh Universitas dibatalkan.

Semarang, 6 Februari 2021
Yang Memberi Pernyataan



10000
METERAI
TEMPEL
3169AJX04711420

Dominikus Dhiko HP
NIM. 20.D1.0156

HALAMAN PENGESAHAN



Judul Tugas Akhir: : Pengaruh DER, DOL, EPS, Ukuran Perusahaan, ROA dan CR terhadap

Risiko Sistematis (Beta Saham) Perusahaan Pertambangan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2013-2017

Diajukan oleh : Dominikus Dhiko Hp

NIM : 20.D1.0156

Tanggal disetujui : 08 Maret 2021 Telah disetujui oleh

Pembimbing : Drs. B. Junianto Wibowo M.S.M.

Penguji 1 : Dr. Widuri Kurniasari S.E., M.Si.

Penguji 2 : Y. Wisnu Djati Sasmito S.E., M.Si.

Penguji 3 : Drs. B. Junianto Wibowo M.S.M.

Ketua Program Studi : Dr. Widuri Kurniasari S.E., M.Si.

Dekan : Drs. Theodorus Sudimin M.S.

Halaman ini merupakan halaman yang sah dan dapat diverifikasi melalui alamat di bawah ini.

sintak.unika.ac.id/skripsi/verifikasi/?id=20.D1.0156

MOTTO DAN PERSEMBAHAN

MOTTO

“Segala perkara dapat kutanggung di dalam Dia yang memberi kekuatan kepadaku. (Filipi 4 : 13)”

PERSEMBAHAN

Skripsi ini saya persembahkan untuk :

Tuhan Yesus Kristus yang selalu memberi kemudahan jalan dan kekuatan sehingga skripsi ini dapat terselesaikan dengan tepat waktu.

Keluarga terutama kedua orang tua saya yang selalu memberikan dukungan, motivasi, kasih sayang, kekuatan, dan doa untuk penulis selama ini.

Dan untuk para teman saya yang sudah memberikan semangat, dukungan serta doa dan ikut menghibur suasana hati disaat penulis berada dalam kejenuhan

KATA PENGANTAR

Puji dan Syukur penulis panjatkan pada Tuhan yang Maha Kuasa atas berkat dan rahmat-Nya penulis telah berhasil menyelesaikan tugas untuk menyusun skripsi ini, yang berjudul “Pengaruh DER, DOL, EPS, Ukuran Perusahaan, ROA dan CR terhadap Risiko Sistematis (Beta Saham) Perusahaan Pertambangan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2013-2017”

Dalam penyusunan skripsi ini telah banyak bantuan dan budi baik yang penulis terima oleh karena itu pada kesempatan ini penulis menyampaikan ucapan terima kasih yang sedalam-dalamnya kepada yang terhormat :

1. Bapak Drs. Theodorus Sudimin, MS. selaku Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis.
2. Bapak Drs. B. Junianto MSM, selaku Dosen Pembimbing yang telah senantiasa meluangkan waktu, tenaga, dan pikiran untuk membantu penulis dalam menyelesaikan laporan skripsi ini.
3. Bapak Y. Wisnu Djati Sasmito, SE., M.Si, dan Ibu Dr. Widuri Kurniasari, SE, MSi selaku Dosen Penguji yang telah membantu memberikan saran, masukan, dan pengarahan yang baik dalam penyelesaian skripsi ini.
4. Bapak dan Ibu Dosen Program Studi Manajemen yang telah memberikan bekal ilmu pengetahuan yang berguna bagi penulis.
5. Seluruh Staff Tata Usaha Fakultas Ekonomi dan Bisnis yang turut membantu penulis dalam segala urusan administrasi dan juga surat perijinan dalam proses membuat laporan skripsi ini.
6. Terimakasih kepada kedua Orang Tua saya yang telah mendukung sepenuhnya.
7. Terimakasih kepada Adik saya Andreas Rio Haryo Prabowo yang telah mendukung saya dalam pembuatan penelitian ini.

8. Terimakasih kepada Ayu Larasati yang telah membantu, menemani serta mendukung saya dalam pengerjaan penelitian ini. ILOVEYOU.

Semoga Tuhan Yang Maha Kuasa memberikan berkat dan rahmat-Nya kepada kita semua dan semoga amal serta budi baik yang telah diberikan kepada penulis akan mendapat imbalan yang setimpal dari-Nya.

Akhir kata penulis tutup dengan suatu pengharapan semoga skripsi ini dapat memberikan manfaat, khususnya bagi penulis dan umumnya bagi semua pihak.

Semarang, 17 Maret 2021



**HALAMAN PERNYATAAN PERSETUJUAN PUBLIKASI SKRIPSI
UNTUK KEPENTINGAN AKADEMIS**

Sebagai civitas akademika Universitas Katolik Soegijapranata, saya yang bertanda tangan dibawah ini :

Nama : Dominikus Dhiko Haryo Prakoso

NIM : 20.D1.0156

Program Studi : Manajemen

Fakultas : Ekonomi dan Bisnis

Demi pengembangan ilmu pengetahuan, menyetujuan untuk memberikan kepada Universitas Katolik Soegijapranata Hak Bebas Royalti Noneksklusif (*Non-exclusive Royalty-Free Right*) atas skripsi yang berjudul :

“Pengaruh DER, DOL, EPS, Ukuran Perusahaan, ROA dan CR terhadap Risiko Sistematis (Beta Saham) Perusahaan Pertambangan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2013-2017”. Dengan Hak Bebas Royalti Noneksklusif ini Universitas Katolik Soegijapranata berhak menyimpan, mengalihmedia/formatkan, mengelola dalam bentuk pangkalan data (*database*), merawat, dan mempublikasi skripsi di atas dengan mencantumkan nama saya sebagai penulis. Demikian pernyataan ini saya buat dengan sebenarnya.

Dibuat di : Semarang

Pada Tanggal : 17 Maret 2021

Yang Menyatakan



(Dominikus Dhiko)

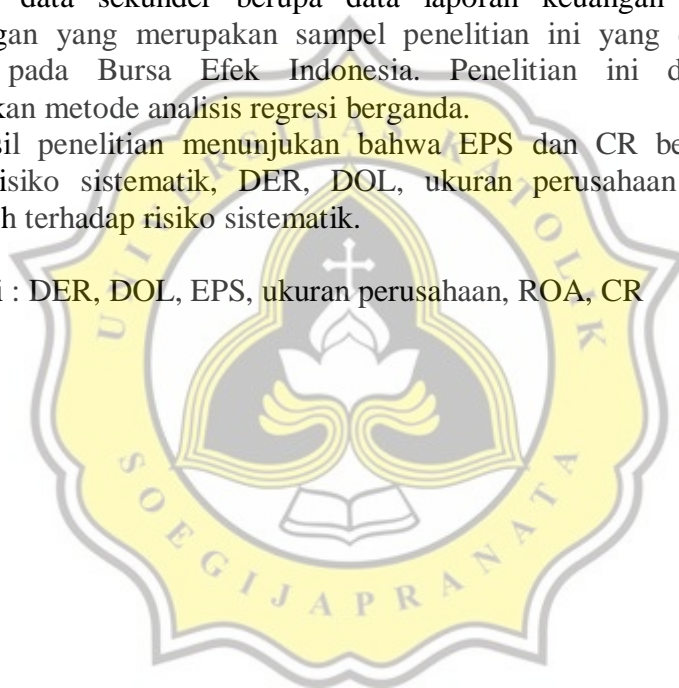
ABSTRAK

Investor dapat merespon baik atau tidaknya kondisi keuangan perusahaan dari peningkatan atau penurunan harga saham yang menunjukkan potensi adanya keuntungan ataupun risiko untuk investor. Investor selalu menghadapi risiko ketika berinvestasi pada perusahaan karena harga sahamnya yang bisa naik dan turun sewaktu-waktu sesuai kondisi perusahaan. Risiko yang dihadapi oleh investor adalah adanya kemungkinan kerugian dari nilai investasi yang telah dibayarkan oleh investor dalam melakukan investasi pembelian saham tersebut.

Data dari perusahaan sampel yang dapat digunakan sebagai sampel dalam penelitian ini berjumlah 28 perusahaan pertambangan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia selama periode 2013-2017 (5 tahun). Jenis data yang dipakai di penelitian ini adalah data sekunder berupa data laporan keuangan pada perusahaan pertambangan yang merupakan sampel penelitian ini yang diambil dari data keuangan pada Bursa Efek Indonesia. Penelitian ini dilakukan dengan menggunakan metode analisis regresi berganda.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa EPS dan CR berpengaruh positif terhadap risiko sistematis, DER, DOL, ukuran perusahaan dan ROA tidak berpengaruh terhadap risiko sistematis.

Kata Kunci : DER, DOL, EPS, ukuran perusahaan, ROA, CR



DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS	iii
HALAMAN PENGESAHAN SKRIPSI	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	v
KATA PENGANTAR	vi
HALAMAN PERNYATAAN PERSETUJUAN PUBLIKASI SKRIPSI	viii
ABSTRAK	ix
DAFTAR ISI	x
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	6
1.3 Tujuan Penelitian	6
1.4 Manfaat Penelitian	7
BAB II LANDASAN TEORI	8
2.1 Teori Signalling	8
2.2 Risiko Sistematis	9
2.3 <i>Debt to Equity Ratio</i> (DER)	10
2.4 <i>Degrees of Operating Leverage</i> (DOL)	12
2.5 <i>Earning per Share</i> (EPS)	13
2.6 Ukuran Perusahaan	14
2.7 <i>Return on asset</i> (ROA)	15
2.8 <i>Current Ratio</i> (CR)	16
2.9 Penelitian Terdahulu	17
2.10 Kerangka Pikir Penelitian	18
2.11 Definisi Operasional	18

2.12 Hipotesis Penelitian	20
BAB III METODE PENELITIAN	24
3.1 Obyek dan Lokasi Penelitian	24
3.2 Populasi dan Sampel	24
3.3 Jenis dan Sumber Data	25
3.4 Teknik Pengumpulan Data	25
3.5 Teknik Analisis Data	25
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	28
3.1 Statistik Deskriptif Variabel Penelitian	28
3.2 Uji Asumsi Klasik	30
3.3 Persamaan Regresi Berganda	33
3.4 Uji Hipotesis	34
3.5 Pembahasan	35
BAB V PENUTUP	39
4.1 Kesimpulan	39
4.2 Keterbatasan Penelitian	39
4.3 Saran	39
DAFTAR PUSTAKA	



DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 <i>Research gap</i> dari penelitian terdahulu	17
Tabel 3.1 Sampel Penelitian	24
Tabel 3.2 Kriteria Autokorelasi	26
Tabel 4.1 Hasil Analisis Deskriptif Statistik Awal	28
Tabel 4.2 Uji Normalitas	31
Tabel 4.3 Hasil Uji Multikolinearitas	31
Tabel 4.4 Hasil Uji Autokorelasi	32
Tabel 4.5 Hasil Uji Glejser	33
Tabel 4.6 Pengujian Hipotesis	33



DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Penelitian

18



