

**ANALISIS PENGARUH SENTIMENT INVESTOR DAN INDEKS
KEYAKINAN KONSUMEN TERHADAP RETURN STOCK PADA
PERUSAHAAN SEKTOR BARANG KONSUMSI YANG
TERDAFTAR DI BEI 2018-2019**

Ingriani A. Said

Mahasiswa Program Studi Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis
Universitas Khairun

Dr. E. Hartaty Hadady, SE., M.Si

Dosen Program Studi Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis
Universitas Khairun

Fadli Ali Taslim, SE., M.Si

Dosen Program Studi Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis
Universitas Khairun

Abstract

Ingriani A. Said, 2021. *Effect of Analysis investor sentiment and consumer confidence index on stock return on consumption sector companies registered in BEI 2018-2019. Chairman: Hartaty Hadady, Member: Fadli Ali Taslim*

This study aims to determine and analyze the effect of investor sentiment and consumer confidence index on return stock in consumer goods sector companies listed on the Indonesian stock exchange in 2018-2019. The sample in this study using purposive sampling method. Based on the results of sample selection according to the criteria that have been made, as many as 35 samples of the consumer goods sector or as many as 70 observation units in 2018 to 2019 can be selected. The analysis method used in this study is to use multiple regression analysis and data panels.

The results of research that has been conducted using panel data show that investor sentiment has a positive and insignificant effect on stock returns, while the consumer confidence index has a negative and significant effect on stock returns.

Keywords: Return Stock, Investor Sentiment, and Consumer Confidence Index.

Abstrak

Ingriani A. Said, 2021. Analisis Pengaruh Sentiment Investor dan Indeks Keyakinan Konsumen Terhadap Return Stock Pada Perusahaan Sektor Barang Konsumsi yang Terdaftar di BEI 2018-2019. Pembimbing I: Hartaty Hadady, Pembimbing II: Fadli Ali Taslim

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui dan menganalisis pengaruh sentiment investor dan indeks keyakinan konsumen terhadap return stock pada perusahaan sektor barang konsumsi yang terdaftar di bursa efek indonesia tahun 2018-2019. Sampel dalam penelitian ini menggunakan metode purposive sampling. Berdasarkan hasil pemilihan sampel sesuai dengan kriteria yang telah dibuat, maka dapat dipilih sebanyak 35 sampel sektor barang konsumsi atau sebanyak 70 unit observasi pada tahun 2018 hingga 2019. Metode analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah dengan menggunakan analisis regresi berganda dan panel data.

Hasil penelitian yang telah dilakukan dengan menggunakan panel data menunjukkan bahwa sentimen investor berpengaruh positif dan tidak signifikan terhadap return saham sedangkan indeks keyakinan konsumen berpengaruh negatif dan signifikan terhadap return saham.

Kata kunci: Return Stock, Sentimen Investor, dan Indeks Keyakinan Konsumen