

ABSTRAK

Analisis Pengaruh Faktor Fundamental dan Resiko Sistematis Terhadap Harga Saham (Studi Empiris Pada Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di BEI)

Oleh: Ocky Ainnur Rochmah

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh faktor-faktor fundamental dan risiko sistematis terhadap harga saham pada perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Jenis penelitian ini adalah penelitian kuantitatif. Populasi pada penelitian ini adalah 141 perusahaan manufaktur yang terdaftar di BEI. Sampel pada penelitian ini sebanyak 61 perusahaan. Sumber data adalah data sekunder. Metode pengumpulan data adalah dengan menggunakan metode *purposive sampling*. Penelitian ini menggunakan model analisis regresi berganda dengan persamaan kuadrat terkecil atau *ordinary least square* (OLS) untuk menganalisis pengaruh faktor-faktor fundamental dan risiko sistematis terhadap Harga Saham.

Hasil Penelitian menyimpulkan bahwa: (1) Faktor-faktor fundamental (*return on asset, earning per share, debt to equity ratio, price earning ratio*) dan risiko sistematis secara bersama-sama berpengaruh sebesar 46,8% terhadap harga saham, sedangkan selebihnya yaitu sebesar 53,2% dipengaruhi oleh faktor yang lain. (2) Secara parsial, Faktor fundamental (*return on asset dan earning per share*) berpengaruh signifikan positif terhadap harga saham. Faktor fundamental (*debt to equity ratio, price earning ratio*) dan risiko sistematis tidak berpengaruh signifikan terhadap harga saham.