

ABSTRAK

Tashya Farradila. 2021. “Analisa Pengaruh Faktor – Faktor Fundamental Dan Risiko Sistematis Terhadap Harga Saham Perbankan Yang *Listed* Di Bursa Efek Indonesia Tahun 2016 – 2020”. Jurusan Magister Manajemen, STIE Indonesia Banking School. Pembimbing Dr. Muchlis, Ak. MBM.

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisa pengaruh faktor –faktor fundamental dan risiko sistematis terhadap harga saham perbankan yang listed di Bursa Efek Indonesia tahun 2016 – 2020. Untuk mengetahui apa saja yang berpengaruh terhadap harga saham secara keseluruhan mulai dari makroekonomi sampai internal perusahaan.

Data yang diambil merupakan *data publish* secara triwulan dari tahun 2016 sampai 2020, dengan kode saham bank yang terpilih meliputi BBKA, BBNI, BBRI, BJBR, BJTM, dan BMRI. Analisa data dilakukan dengan menggunakan *Software SPSS*.

Analisa Makroekonomi pada uji signifikansi parsial menghasilkan pertumbuhan PDB dan Indeks Dow Jones berpengaruh positif terhadap harga saham yang diwakili JK-FINA, pada uji signifikansi simultan analisa Makroekonomi pada penelitian ini berpengaruh signifikan terhadap harga saham yang diwakili oleh JK-FINA, sedangkan pada Analisa Perusahaan pada uji signifikansi parsial menghasilkan ROE dan Beta berpengaruh negatif pada harga saham. Variabel lain yaitu EPS,PBV, *PREDJKFINA* berpengaruh positif pada harga saham, lalu DY tidak berpengaruh terhadap harga saham, dan pada uji signifikansi simultan analisa perusahaan pada penelitian ini juga berpengaruh terhadap harga saham.

Kata Kunci : Regresi, Pertumbuhan PDB, Indeks Dow Jones, BI Rate, ROE, EPS, PBV, ,DY, BETA dan *Predicted value JKFINA*