

ABSTRAK

Novi Hariyanti, No Bp : 14101155310285, Manajemen 2018, ““Analisis Pengaruh Faktor Fundamental Dan Risiko Pasar Terhadap Perubahan Index Harga Saham Gabungan Pada Industri Perbankan Di Bursa Efek Indonesia” Dibawah Bimbingan **Hanna Pratiwi, SE. MM (Pembimbing I) Dan Yamasitha SE. MM (Pembimbing II).**

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui Pengaruh ROA dan Risiko Pasar Terhadap Indeks Harga Saham Perusahaan Perbankan Yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Pada Penelitian ini variabel yang diteliti adalah variabel ROA dan Risiko Pasar sebagai variabel bebas dan indeks harga saham Perbankan sebagai variabel terikat. Teknik pengumpulan data yang digunakan pada penelitian ini adalah metode dokumentasi. Metode analisis yang digunakan yaitu metode deskriptif, analisis regresi berganda, analisis koefisien determinasi, uji t dan uji f.

Pada hasil penelitian didapatkan a) variabel ROA tidak berpengaruh dan signifikan terhadap indeks harga saham perbankan, dibuktikan dengan nilai signifikan dengan tingkat signifikan $0,975 > 0,05$. b) variabel Risiko Pasar berpengaruh negatif dan tidak signifikan terhadap indeks harga saham Perbankan, dibuktikan dengan dengan tingkat signifikan $0,000 < 0,05$. c) Variabel ROA dan Risiko Pasar berpengaruh terhadap indeks harga saham perbankan, dibuktikan dengan tingkat signifikan $0,000 < 0,05$. Berdasarkan hasil uji Koefisien Determinasi, variabel ROA dan Risiko Pasar memberikan sumbangan sebesar 99,9 % terhadap indeks harga saham manufaktur. Sedangkan sisanya 0,1 % dipengaruhi oleh variabel lain yang tidak diteliti pada penelitian ini.

Akhirnya penulis menyarankan untuk pemerintah untuk dapat harus bijak dalam mengendalikan kondisi-kondisi makro ekonomi agar dapat menciptakan kondisi ekonomi makro yang stabil dan lebih baik di masa yang akan datang. Serta, bagi investor dapat memilih produk investasi yang lebih menguntungkan.

Kata Kunci : ROA, Risiko Pasar Indeks Harga Saham Sektor Perbankan.