

INTISARI

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh faktor-faktor yang mempengaruhi indeks harga saham yang terdiri dari faktor fundamental dan faktor teknikal. Faktor fundamental pada penelitian ini adalah EPS, PER, ROA, DER, DPR, PBV, dan NPM. Sedangkan faktor teknikal pada penelitian ini adalah Volume Perdagangan terhadap Indeks Harga Saham.

Objek penelitian ini adalah perusahaan-perusahaan yang terdaftar di Jakarta Islamic Indeks (JII). Data yang digunakan dalam penelitian ini diperoleh dari laporan keuangan tahunan perusahaan yang ada di IDX pada tahun 2011-2014. Sampel penelitian dipilih menggunakan teknik *purposive sampling* sehingga diperoleh hasil 49 perusahaan yang memenuhi kriteria. Sebelumnya data telah diuji dengan pengujian asumsi klasik dan sudah terbebas dari gejala normalitas, heteroskedastisitas, multikolinieritas, dan autokorelasi.

Dari hasil analisis diketahui bahwa EPS dan ROA berpengaruh positif signifikan terhadap Indeks Harga Saham (IHS), dan Volume Perdagangan berpengaruh negatif signifikan terhadap Indeks Harga Saham (IHS). Sedangkan PER, DER, DPR, PBV, dan NPM tidak berpengaruh signifikan terhadap Indeks Harga Saham (IHS). Kemampuan prediksi kedelapan variabel tersebut terhadap IHS sebesar 70,1%, sedangkan sisanya sebanyak 29,9% dijelaskan oleh variabel lain yang tidak termasuk dalam penelitian ini.

Kata-kata kunci: IHS, EPS, PER, ROA, DER, DPR, PBV, NPM, Volume Perdagangan

ABSTRACT

This research is meant to find out the influence factor of the stock price index which consist of fundamental factor and technical factor. Fundamental factor of this research are EPS, PER, ROA, DER, DPR, PBV, and NPM. Meanwhile, the technical factor of this research is volume trading to the stock price index.

The object of this research is manufacturing company which is listed in Jakarta Islamic Index (JII). The data of this research is obtained from the annual financial statement at IDX in 2011-2014. The sample of this research is selected by using purposive sampling technique so that it obtains 49 companies which are meet the criteria. Previously, the data has been tested by using classic assumption test and it is free from symptoms of normality, heteroscedasticity, multicollinearity and autocorrelation.

From the result of analysis found that EPS and ROA have positive influence to the Stock Price Index (IHS), and volume trading have negative influence to the Stock Price Index (IHS), meanwhile PER, DER, DPR, NPM and PBV does not have any influence to the Stock Price Index (IHS). The prediction ability of those eight variables to the Stock Price Index (IHS) is 70,1%, meanwhile the rest is 29,9% it has been explained by other variable which is not including to this research.

Keywords: *IHS, EPS, PER, ROA, DER, DPR, PBV, NPM, Volume Trading.*