

ABSTRAKSI

Penelitian ini dilakukan untuk menguji faktor-faktor yang mempengaruhi harga saham baik secara internal yaitu yang bersifat fundamental meliputi *Earning Per Share* (EPS) dan *Return On Asset* (ROA) maupun secara eksternal yaitu yang bersifat teknikal (berpengaruh langsung maupun tidak langsung yang mempengaruhi harga saham) meliputi tingkat bunga dan valuta asing (kurs dolar AS).

Perusahaan yang dipilih adalah perusahaan perbankan nasional yang dipilih berdasarkan kriteria yang telah ditetapkan selama kurun waktu tahun 2000 sampai 2002.

Penentuan sampel dalam penelitian ini dilakukan secara *purposive sampling*. Adapun analisa data yang dilakukan adalah dengan regresi berganda.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa EPS, ROA dan Valuta Asing berpengaruh terhadap harga saham sedangkan tingkat bunga tidak memiliki pengaruh terhadap harga saham.

Kata kunci : *Earning Per Share, Return On Asset.*

