

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh tingkat kesehatan bank terhadap harga saham. Pengukuran kesehatan bank dilakukan dengan menggunakan metode *risk-based bank rating* (RBBR). Faktor-faktor kesehatan bank yang diukur meliputi *risk profile* yang diukur dengan LDR dan NPL, faktor GCG yang diukur dengan peringkat *self assessment* GCG, faktor *earning* yang diukur dengan ROE dan BOPO, dan faktor *capital* yang diukur dengan CAR. Populasi dalam penelitian ini adalah perusahaan perbankan yang melaporkan laporan tahunan 2011-2015 pada website IDX. Teknik pengambilan sampel menggunakan *purposive sampling* yang menghasilkan sampel sebanyak 31 bank. Penelitian ini menggunakan metode analisis regresi berganda untuk menguji hipotesis penelitian. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa ROE dan BOPO berpengaruh negatif terhadap harga saham, sedangkan LDR, NPL, GCG dan CAR tidak berpengaruh terhadap harga saham.

Kata kunci: kesehatan bank, harga saham, RBBR, LDR, NPL, GCG, ROE, BOPO, dan CAR.



ABSTRACT

This research aims to determine the effect of bank's health on the stock price. Bank's health measured by risk-based bank rating method (RBBR). There are factors of bank's health which mention as risk profile factor's recognize by LDR and NPL, GCG factor's forecasted by self assessment rank of GCG, earning factor's identified by ROE and BOPO, and the last factor known as capital factor's called by CAR. The population of this study are banking companies which reported annual report at IDX website on 2011-2015. There are 31 banks which is sampled by purposive sampling technique. Multiple regression analysis is used to test the hypotheses. The result of this research indicated that ROE and BOPO have negative effect on bank's health, while LDR, NPL, GCG and CAR is not proved to have effect of bank's health.

Keywords: bank's health, stock price, RBBR, LDR, NPL, GCG, ROE, BOPO and CAR.

