

ABSTRAK

ANALISIS PENGARUH ROE, ROA, NPM, DAN DER TERHADAP HARGA SAHAM SEKTOR PERBANKAN INDEKS LQ-45 MENGUNAKAN REGRESI DATA PANEL

Niken Cahyaning Leksono
Program Studi Statistika, Fakultas Matematika dan Ilmu Pengetahuan Alam
Universitas Islam Indonesia

Pertumbuhan perekonomian di Indonesia sangat erat kaitannya dengan perusahaan perbankan, karena perusahaan perbankan memiliki peran yang sangat penting dalam mempengaruhi dan memfasilitasi aktivitas ekonomi secara keseluruhan. Salah satu cara yang dilakukan perusahaan perbankan dalam memenuhi kebutuhannya yaitu menerbitkan saham di pasar modal. Saham adalah instrumen keuangan yang mewakili bagian kepemilikan dari sebuah perusahaan. Menurut BEI terdapat 45 perusahaan yang memiliki indeks saham terbaik, disebut dengan indeks LQ-45. Faktor yang mempengaruhi naik turunnya harga saham suatu perusahaan yaitu faktor eksternal dan faktor internal. Faktor internal dapat berupa laporan keuangan perusahaan yang terdiri dari ROE, ROA, NPM, dan DER. Metode analisis untuk penelitian ini adalah regresi data panel yang memiliki gabungan tipe data *time series* dan *cross section*. Hasil penelitian menunjukkan bahwa ROE dan ROA berpengaruh secara signifikan terhadap harga saham sektor perbankan indeks LQ-45, sedangkan NPM dan DER tidak berpengaruh secara signifikan terhadap harga saham indeks LQ-45.

Kata Kunci : BEI, Harga Saham, Indeks LQ-45, Perbankan, Regresi Data Panel.