

ABSTRAK

PENGARUH FAKTOR-FAKTOR FUNDAMENTAL TERHADAP HARGA SAHAM

(Studi pada perusahaan yang tergabung dalam Jakarta Islamic Index (JII) di Bursa Efek Indonesia tahun 2014-2018)

Oleh

MUHAMAD ARDIYANTO

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh faktor-faktor fundamental terhadap harga saham. Penelitian ini menggunakan Teori Sinyal dengan menggunakan variabel dependen harga saham dan variabel independen yaitu *debt to equity ratio*, *return on equity*, *earning per share*, dan *firm size*. Objek dalam penelitian ini adalah perusahaan yang tergabung dalam *Jakarta Islamic Index (JII)* di Bursa Efek Indonesia tahun 2014-2018. Sampel dalam penelitian ini diperoleh sebanyak 11 perusahaan dengan metode *purposive sampling*. Berdasarkan hasil penelitian menggunakan analisis regresi linier berganda dengan variabel dependen yaitu harga saham dan ditemukan bahwa *debt to equity ratio*, *return on equity*, *earning per share*, dan *firm size* terdapat pengaruh terhadap harga saham.

Kata kunci: harga saham, *debt to equity ratio*, *return on equity*, *earning per share*, dan *firm size*.

ABSTRACT

THE INFLUENCE OF FUNDAMENTAL FACTORS ON STOCK PRICE (*Study of companies incorporated in the Jakarta Islamic Index (JII) on the Indonesia Stock Exchange in 2014-2018*)

By

MUHAMAD ARDIYANTO

This study aims to determine the effect of fundamental factors on stock prices. This research uses Signal Theory by using the dependent variable stock price and independent variables namely debt to equity ratio, return on equity, earnings per share, and firm size. The object in this study is a company incorporated in the Jakarta Islamic Index (JII) on the Indonesia Stock Exchange in 2014-2018. The samples in this study were obtained by 11 companies with a purposive sampling method. Based on the results of the study using multiple linear regression analysis with the dependent variable namely stock prices and found that debt to equity ratio, return on equity, earnings per share, and firm size have an influence on stock prices.

Keywords: stock price, debt to equity ratio, return on equity, earning per share, and firm size.