

ABSTRAK

ANALISIS PENGARUH PBV, ROE, PER, NILAI TUKAR *DOLLAR* AS DAN INFLASI TERHADAP HARGA SAHAM PERUSAHAAN *CONSUMER GOODS* YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK INDONESIA PERIODE 2001-2010

Oleh

SASI NGATI NINGRUM

Investasi yang dapat digunakan untuk memperoleh keuntungan di masa yang akan datang adalah Pasar Modal. Pasar modal yang efisien dapat tercermin dari informasi yang relevan, dimana informasi relevan tersebut dapat diperoleh dari kinerja fundamental keuangan emiten (PBV, ROE, PER, Nilai Tukar *Dollar As* dan Inflasi).

Tujuan penelitian ini untuk mengetahui pengaruh signifikan PBV, ROE, PER, Nilai Tukar *Dollar As* dan Inflasi Terhadap Harga Saham Perusahaan *Consumer Goods* yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia. Analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah analisis regresi linier berganda. Hipotesis yang diajukan adalah diduga adanya pengaruh PBV, ROE, PER, nilai tukar *dollar as*, dan tingkat inflasi terhadap harga saham sektor *consumer goods* di bursa efek indonesia periode 2001-2010.

Hasil analisis uji F, terdapat hubungan yang bersifat pengaruh antara PBV, ROE, PER, Nilai Tukar dan Inflasi secara serentak terhadap harga saham sektor *consumer goods* di bursa efek indonesia periode 2001-2011. Hasil uji t, menunjukkan PBV, ROE, PER, Nilai Tukar dan Inflasi secara parsial berpengaruh terhadap harga saham sektor *consumer goods* di bursa efek indonesia. Koefisien determinasi ($R^2 = 0,434$ atau 43,4%) yang artinya variabel bebas (PBV, ROE, PER, Nilai Tukar dan Inflasi) hanya 43,4% menjelaskan harga saham dan 56,6% dijelaskan oleh faktor lainnya.

Kata Kunci : Harga Saham, PBV, ROE, PER, Nilai Tukar dan Inflasi