

**KEMENTERIAN RISET, TEKNOLOGI, DAN PENDIDIKAN TINGGI
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS UNIVERSITAS AIRLANGGA**

**PROGRAM STUDI : EKONOMI ISLAM
DAFTAR No. :**

ABSTRAK

SKRIPSI SARJANA EKONOMI ISLAM

**NAMA : VEGA ZAHRAH NARENDRA DUHITA
NIM : 041511433028
TAHUN PENYUSUNAN : 2018-2019**

JUDUL:

Pengaruh Faktor Fundamental dan Risiko Sistemik terhadap Harga Saham Perusahaan di *Jakarta Islamic Index* (JII) Periode 2014-2017

ISI:

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui dan menjelaskan pengaruh faktor fundamental keuangan (DER, NPM, ROA, TATO, EPS, dan PER) serta Risiko Sistemik (Beta Saham) terhadap harga saham perusahaan yang terdaftar di *Jakarta Islamic Index* periode 2014 hingga 2017. Pendekatan yang digunakan dalam penelitian ini adalah pendekatan kuantitatif untuk menemukan hubungan antar variabel yang diuji. Data yang digunakan dalam penelitian ini merupakan data sekunder meliputi nilai masing-masing rasio yang digunakan serta harga saham penutupan setiap perusahaan. Objek penelitian adalah perusahaan yang terdaftar di *Jakarta Islamic Index* selama periode penelitian yang berjumlah 16 perusahaan. Fokus penelitian ini adalah untuk mengetahui apakah variabel yang digunakan mempengaruhi harga saham perusahaan atau tidak dengan menggunakan uji regresi linier berganda menggunakan alat bantu Statistik IBM SPSS 25 dengan menetapkan *level of significant* sebesar 5%.

Hasil penelitian menunjukkan secara simultan faktor fundamental dan risiko sistemik berpengaruh secara positif dan signifikan terhadap harga saham perusahaan. Sedangkan secara parsial variabel DER, ROA, TATO, dan EPS memiliki pengaruh positif signifikan terhadap harga saham perusahaan di JII selama periode 2014-2017, dan variabel NPM, PER, serta beta saham memiliki pengaruh tidak signifikan terhadap harga saham perusahaan di JII selama periode 2014-2017.

Kata Kunci: Analisis Fundamental, Harga Saham, Risiko Sistemik, *Jakarta Islamic Index*

**MINISTRY OF RESEARCH, TECHNOLOGY AND HIGHER
EDUCATION
FACULTY OF ECONOMICS AND BUSINESS AIRLANGGA
UNIVERSITY**

**STUDY PROGRAM: ISLAMIC ECONOMIC
LIST No:**

ABSTRACT

THESIS OF ISLAMIC ECONOMIC BACHELOR

NAME: VEGA ZAHRAH NARENDRA DUHITA

STUDENT ID: 041511433028

YEAR OF WRITING: 2018-2019

TITLE:

The Influence of Fundamental Factors and Systematic Risks on Companies' Stock Price on Jakarta Islamic Index (JII) Period 2014-2017.

CONTENT:

This research aims to find out and explain the influence of financial fundamental factors (DER, NPM, ROA, TATO, EPS, and PER) and systematic risks (Stock Beta) on stock price of the companies which were registered on Jakarta Islamic Index period 2014-2017. It uses quantitative approach to find out the relation between one variable and another. Data used is a secondary data including the value of every ratio used and closing stock price in every company. The object of the research is 16 companies which were registered on Jakarta Islamic Index during the research period. This research focuses on whether the variables used affect companies' stock price by using multiple linier regression test and statistical tool IBM SPSS 25 and determining the level of significance 5%.

The results of the research show that the fundamental factors and systematic risks simultaneously have a positive and significant effect on companies' stock price on JII during period 2014-2017. Meanwhile, the variables of DER, ROA, TATO, and EPS partially have a positive and significant effect, the variables of NPM, PER, and stock beta have insignificant effect on companies' stock price on JII during period 2014-2017.

Keywords: Fundamental Analysis, Stock Price, Systematic Risks, Jakarta Islamic Index.