ANALISIS PENGARUH FAKTOR FUNDAMENTAL DAN RISIKO SISTEMATIK TERHADAP HARGA SAHAM PADA PERUSAHAAN SEKTOR INDUSTRI BARANG KONSUMSI DI BEI

Rivo Transza , Popi Fauziati , Ethika

Jurusan Akuntansi, Fakultas Ekonomi Universitas Bung Hatta

E-mail Rivo\_smandel@yahoo.co.id

**Abstrak**

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh faktor fundamental dan resiko sistematik terhadap harga saham sektor industri konsumsi di bursa efek Indonesia. Pengambilan sampel dilakukan dengan metode *purposive sampling*. Sampel yang diambil adalah seluruh perusahaan sektor barang konsumsi (29 perusahaan) yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia yang memiliki laporan keuangan berupa annual report tahun 2009 – 2013. Pengolahan dan analisis data menggunakan analisis regresi linier berganda dengan bantuan program SPSS. Variabel dependent adalah harga saham dan variabel independent adalah ROA, ROE, DER, PER, EPS, BV dan Beta. Hasil penelitian ini menunjukkan hanya faktor fundamental ROA (Return On Assets) yang tidak berpengaruh terhadap harga saham, sedangkan faktor fundamental (ROE, EPS, BV, PER dan DER) berpengaruh terhadap harga saham dan resiko sistematik (beta) tidak berpengaruh terhadap harga saham.

**Kata kunci : Fundamental, Resiko Sistematik dan Harga Saham**