

ABSTRAK

Alfyansyah, Muhammad Fahryandi. 2018. **Pengaruh *Net Profit Margin* (NPM), *Return On Assets* (ROA), Dan *Return On Equity* (ROE) Terhadap Harga Saham Pada Perusahaan Yang Tergabung Dalam Indeks LQ45.** Program Studi Manajemen, Fakultas Ekonomi, Universitas Panca Marga Probolinggo.

Penelitian ini dilakukan pada perusahaan yang tergabung dalam Indeks LQ45 yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia sebanyak 44 perusahaan yang mempunyai laporan keuangan dapat diakses dari tahun 2013 – 2017 dengan tujuan untuk mengetahui adanya pengaruh yang signifikan antara *Net Profit Margin* (NPM), *Return On Assets* (ROA) dan *Return On Equity* (ROE) secara simultan dan parsial terhadap harga saham pada perusahaan yang tergabung dalam indeks LQ45. Untuk mengetahui variabel di antara *Net Profit Margin* (NPM), *Return On Assets* (ROA) dan *Return On Equity* (ROE) yang berpengaruh dominan terhadap harga saham pada perusahaan yang tergabung dalam indeks LQ45.

Jenis penelitian yang digunakan adalah penelitian kausal. Metode pengumpulan data dengan dokumentasi, sampel sebanyak 44 perusahaan yang tergabung dalam Indeks LQ45 yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia yang mempublikasikan laporan keuangan tahunan (*annual report*) secara lengkap periode 2013 – 2017. Metode analisis data berupa analisis regresi linear berganda.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa ada pengaruh yang signifikan antara *Net Profit Margin* (NPM), *Return On Assets* (ROA) dan *Return On Equity* (ROE) secara simultan terhadap harga saham pada perusahaan yang tergabung dalam Indeks LQ45 dengan nilai $F_{hitung} (16,452) > F_{tabel} (2,646)$ dan $sig. F = 0,000$; secara parsial *Net Profit Margin*/NPM dan *Return on Assets*/ROA berpengaruh signifikan terhadap harga saham, sedangkan variabel *Return On Equity* secara parsial tidak menunjukkan pengaruh terhadap harga saham pada perusahaan yang tergabung dalam indeks LQ45; variabel ROA yang berpengaruh dominan terhadap harga saham perusahaan yang tergabung dalam indeks LQ45 tahun 2013 – 2017 yang ditunjukkan dengan dengan nilai *Standardized Coefficients Beta* 0,487 lebih besar dari nilai *Standardized Coefficients Beta* variabel bebas lainnya.

Kata Kunci : Perusahaan LQ45, *Net Profit Margin*, *Return On Assets*, *Return On Equity*