

## ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh *Dividend Yield*, *Retention Ratio*, EPS (*Earning per Share*), dan ROE (*Return on Equity*) terhadap Harga Saham. Objek dalam penelitian ini adalah Perusahaan Perbankan dan Perusahaan Lembaga Keuangan Bukan Bank (LKBB) di Bursa Efek Indonesia antara tahun 2012-2014. Dengan demikian tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui apakah terdapat perbedaan pengaruh *Dividend Yield*, *Retention Ratio*, EPS, dan ROE terhadap Harga Saham antara Perusahaan Perbankan dan Perusahaan Lembaga Keuangan Bukan Bank (LKBB).

Penelitian ini menggunakan metode *purposive sampling* dengan jumlah sampel sebanyak 25 Perusahaan Perbankan dan 31 Perusahaan Lembaga Keuangan Bukan Bank (LKBB) selama periode 2012-2014. Data diperoleh berdasarkan publikasi *Indonesian Capital Market Directory* (ICMD) dan OJK. Teknik analisis yang digunakan adalah regresi berganda dengan persamaan kuadrat terkecil dan uji hipotesis menggunakan t-statistik untuk menguji keberartian pengaruh secara bersama-sama dengan *level of significant* 5%. Selain itu juga dilakukan uji heteroskedastisitas dan uji autokorelasi. Sedangkan untuk menguji perbedaan pengaruh *Dividend Yield*, *Retention Ratio*, EPS, dan ROE antara Perusahaan Perbankan dan Perusahaan Lembaga Keuangan Bukan Bank (LKBB) digunakan uji *Chow Test*.

Hasil penelitian menyimpulkan bahwa EPS berpengaruh signifikan terhadap Harga Saham baik pada Perusahaan Perbankan dan Perusahaan Lembaga Keuangan Bukan Bank (LKBB). Pada Perusahaan Perbankan *Retention Ratio* dan ROE tidak berpengaruh terhadap Harga Saham, dan pada Perusahaan Lembaga Keuangan Bukan Bank (LKBB) *Dividend Yield* tidak berpengaruh terhadap Harga Saham. Pada Perusahaan Perbankan, *Dividend Yield* berpengaruh negatif signifikan terhadap Harga Saham. Sedangkan pada Perusahaan Lembaga Keuangan Bukan Bank (LKBB) *Retention Ratio* berpengaruh positif signifikan terhadap Harga Saham dan ROE berpengaruh negatif signifikan terhadap Harga Saham. Berdasarkan uji *Chow Test* disimpulkan bahwa terdapat perbedaan pengaruh *Dividend Yield*, *Retention Ratio*, EPS, dan ROE antara Perusahaan Perbankan dan Perusahaan Lembaga Keuangan Bukan Bank (LKBB).

Kata Kunci : *Dividend Yield*, *Retention Ratio*, *Earning per Share*, *Return on Equity*, dan Harga Saham