

## ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh Nilai Tukar, Volume Perdagangan, *Return on Assets* (ROA), *Debt to Equity Ratio* (DER), dan *Size* terhadap Harga Saham pada perusahaan yang terdaftar dalam indeks LQ45 periode 2011-2014 di Bursa Efek Indonesia.

Teknik sampling yang digunakan dalam penelitian ini adalah dengan teknik *Purposive Sampling* dengan kriteria Perusahaan yang masuk dalam daftar indeks LQ45 dan terdaftar di bursa efek Indonesia, yang mempublikasikan laporan keuangan secara periodik selama tahun 2011-2014. Data yang digunakan dalam penelitian ini diperoleh dari laporan keuangan tahunan pada *website* Bursa Efek Indonesia dan data yang diperoleh dari bank BI dengan sampel sebanyak 22 perusahaan. Metode analisis data dalam penelitian ini dengan Analisis Regresi Berganda, kemudian menggunakan pengujian asumsi klasik dan pengujian hipotesis menggunakan uji statistik F, uji statistik t dan uji koefisien determinasi Adjusted R<sup>2</sup> dengan tingkat signifikansi sebesar 5%.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa variabel-variabel independen secara simultan (uji F) berpengaruh terhadap Harga Saham dengan tingkat signifikansi 0,000. Sedangkan secara parsial (uji t) menunjukkan bahwa variabel Nilai Tukar berpengaruh negatif dan tidak signifikan terhadap Harga Saham. Variabel Volume Perdagangan dan DER berpengaruh negatif dan signifikan terhadap Harga Saham. Sedangkan ROA dan *Size* berpengaruh positif signifikan terhadap Harga Saham. Nilai adjusted R<sup>2</sup> sebesar 0,939 yang berarti bahwa kemampuan kelima variabel independen dapat menjelaskan Harga Saham sebesar 93,9%, sedangkan sisanya dijelaskan oleh faktor lain.

**Kata Kunci : Harga Saham, Nilai Tukar, Volume Perdagangan, *Return On Assets* (ROA), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Size*.**