

## ABSTRAK

Perusahaan perbankan adalah salah satu industri yang ikut berperan serta dalam pasar modal. Dalam melakukan prediksi harga saham terdapat pendekatan dasar yaitu analisis fundamental dan analisis teknikal. Analisis ini untuk mengetahui pengaruh kinerja perusahaan perbankan terhadap harga saham. Untuk menilai tingkat kesehatan perbankan digunakan metode RBBR yang merupakan standar Bank Indonesia dalam menilai tingkat kesehatan bank. Permasalahan dalam penelitian ini adalah bagaimana komponen RBBR yang diprosikan dengan Beta, GCG, CAR dan NIM mempengaruhi harga saham perusahaan perbankan yang *go public* di Bursa Efek Indonesia (BEI) baik secara parsial maupun simultan. Sedangkan tujuan penelitian ini untuk mengetahui dan menganalisis pengaruh komponen RBBR, dalam hal ini Beta, GCG, CAR dan NIM terhadap harga saham perusahaan perbankan yang *go public* di Bursa Efek Indonesia (BEI).

Populasi dalam penelitian ini adalah sektor perbankan yang *go public* di Bursa Efek Indonesia tahun 2008 sampai 2011, yaitu sebanyak 31 bank. Sampel ditentukan dengan teknik *purposive sampling* dengan tujuan untuk mendapatkan sampel yang representatif sesuai dengan kriteria yang ditentukan. Adapun sampel dalam penelitian ini ada 15 perusahaan perbankan. Variabel dalam penelitian ini ada dua yaitu; variabel bebas meliputi Beta, GCG, CAR dan NIM. Sedangkan untuk variabel terikatnya adalah harga saham pada perusahaan perbankan yang *go public* di BEI. Penelitian ini dianalisis dengan menggunakan regresi berganda.

Berdasarkan hasil penelitian diketahui bahwa secara parsial, NIM dan Beta berpengaruh positif signifikan terhadap harga saham perusahaan perbankan yang *go public* di Bursa Efek Indonesia. Sedangkan untuk GCG berpengaruh negatif signifikan dan CAR tidak berpengaruh signifikan terhadap harga saham perusahaan perbankan yang *go public* di Bursa Efek Indonesia. Hasil uji secara simultan menunjukkan terdapat pengaruh antara Beta, GCG, CAR dan NIM secara bersama-sama terhadap harga saham perusahaan perbankan yang *go public* di Bursa Efek Indonesia. Besarnya pengaruh tersebut adalah 0.54 atau 54 %. Sedangkan sisanya sebesar 46% dipengaruhi faktor lain di luar penelitian atau di luar persamaan regresi.

**Kata Kunci** : Beta, Good Corporate Governance, Capital Adequacy Ratio, Net Interest Margin dan Harga Saham.