

ABSTRAK

Tujuan penelitian ini adalah untuk menguji pengaruh *Earning per Share (EPS)*, *Return on Equity (ROE)*, *Debt to Equity Ratio (DER)* terhadap harga saham. Penelitian ini diambil karena masih terdapat perbedaan penelitian antara penelitian yang satu dengan yang lain serta terdapat perbedaan antara keadaan riilnya dari data penelitian dengan teori yang ada.

Penelitian ini dilakukan dengan menggunakan data sekunder. Teknik sampel yang digunakan adalah *purposive sampling*. Dari dua puluh empat perusahaan, hanya diambil lima belas perusahaan, karena memiliki laporan keuangan secara lengkap tahun 2006 – 2008. Metode analisis yang digunakan adalah analisis regresi linier berganda.

Dengan menggunakan analisa regresi, maka dapat diketahui bahwa *Earning per Share* berpengaruh positif dan signifikan terhadap perubahan harga saham, *Return on Equity* berpengaruh negatif dan signifikan terhadap perubahan harga saham. *Debt to Equity Ratio* berpengaruh negatif dan tidak signifikan terhadap perubahan harga saham. Dari penelitian yang dilakukan, maka diperoleh kesimpulan bahwa harga saham dipengaruhi oleh *Earning per Share*. Faktor-faktor lain seperti *Return on Equity* dan *Debt to Equity Ratio* ternyata tidak berpengaruh terhadap harga saham.

Kata kunci: Harga Saham, *Earning per Share*, *Return on Equity* dan *Debt to Equity Ratio*