

ABSTRAKSI

Penelitian ini dilakukan untuk mengetahui seperti apa dan seberapa besar pengaruh dari jumlah pinjaman yang diberikan oleh bank terhadap harga saham perusahaan pada sektor *consumer goods industry*, dan sektor *property, real estate*, dan *building construction industry*, kemudian membandingkannya. Variabel yang diteliti di dalam penelitian adalah jumlah pinjaman yang diberikan oleh bank kepada perusahaan dan harga saham perusahaan tersebut.

Dengan menggunakan metode Data Panel, data sekunder yang diambil adalah data tiga bulanan dari jumlah pinjaman yang diberikan oleh bank kepada perusahaan dan harga saham perusahaan tersebut. Semua data disajikan dalam bentuk logaritma.

Setelah melalui pemilihan metode data panel yang akan digunakan, berdasarkan *Chow Test* baik pada sektor *consumer goods industry*, dan sektor *property, real estate*, dan *building construction industry* disarankan menggunakan *Pooled Least Square*.

Dari hasil regresi diketahui bahwa jumlah pinjaman yang diberikan oleh bank berpengaruh positif terhadap harga saham perusahaan di sektor *consumer goods industry*, dan sektor *property, real estate*, dan *building construction industry*. Pada sektor *property, real estate*, dan *building construction industry*, pinjaman dari bank sedikit lebih besar pengaruhnya terhadap harga saham perusahaan dibanding pada sektor *consumer goods industry*.

Keyword: pinjaman dari bank, harga saham, sektor *consumer goods*, sektor *property, real estate*, dan *building construction industry*, data panel.