

ABSTRAK

Lidia Yohana Ngurah :

Skripsi

Pengaruh Inflasi, Tingkat Suku Bunga, dan Nilai Tukar Rupiah Terhadap Harga Saham pada Perusahaan yang Tergabung dalam LQ45

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisa pengaruh dari inflasi, tingkat suku bunga dan nilai tukar rupiah terhadap harga saham pada perusahaan yang tergabung dalam LQ45 baik secara simultan maupun parsial. Teknik analisis yang digunakan adalah analisis regresi linear berganda, untuk uji hipotesis menggunakan uji-F dan uji-t dengan tingkat signifikansi 5%. Sementara untuk pengujian asumsi klasik dalam penelitian ini menggunakan uji normalitas, uji multikolinearitas, uji heteroskedastisitas dengan menggunakan metode Park, dan uji autokolerasi. Populasi dari penelitian ini adalah perusahaan-perusahaan yang tergabung dalam LQ45 dari periode 2013 sampai 2015. Dan untuk pengambilan sampel dalam penelitian ini menggunakan metode *purposive sampling*, maka diperoleh 23 perusahaan yang tergabung dalam LQ45. Berdasarkan hasil penelitian dengan menggunakan uji-F, dapat disimpulkan bahwa pada variabel inflasi, tingkat suku bunga dan nilai tukar rupiah memiliki pengaruh yang signifikan terhadap harga saham secara simultan. Berdasarkan hasil penelitian secara parsial dengan menggunakan uji-t, dapat disimpulkan bahwa hanya variabel inflasi yang mempunyai hubungan yang positif dan berpengaruh yang signifikan terhadap harga saham. Sedangkan untuk variabel tingkat suku bunga memiliki hubungan yang negatif dan tidak memiliki pengaruh yang signifikan terhadap harga saham. Dan untuk variabel nilai tukar rupiah memiliki pengaruh, tetapi tidak berpengaruh secara signifikan terhadap harga saham pada perusahaan yang tergabung dalam LQ45.

Kata Kunci : *Inflasi, Tingkat Suku Bunga, Nilai Tukar Rupiah, Harga Saham, LQ45*

ABSTRACT

Lidia Yohana Ngurah :

Thesis

The effect of inflation, interest rates, and the rupiah exchange rate toward stock prices on companies joined in LQ45

This study attempts to analyze the effects of inflation, interest rates and the rupiah exchange rate toward stock prices on companies joined in LQ45 on simultaneously and partial. Analysis techniques used analytics linear regression multiple, for hypothesis test using F-test and t-test with a significance level of 5%. As for the classic assumption test in this study using normality test, multicollinearity test, heteroscedasticity test using the method of Park and autokoleration test. The population of this study is companies that joined in LQ45 from a period of 2013 to 2015. And for the sample in this research using purposive sampling method , and obtained 23 companies joined in LQ45. Based on the results of research with using F-test , we can be concluded that on the variables of inflation , interest rates and exchange rate having influence a significant impact on stock prices in simultaneously. While based on the result of research in partial, only inflation has positive relationship and significant influence on stock prices. The interest rates has negative relationship and do not have significant influence on stock prices. And for the exchange rate variable has an influence, but does not significant influence on stock prices on companies joined in LQ45.

Keywords: *inflation , interest rates , the rupiah exchange rate , stock prices , LQ45*