

**PENGARUH SUKU BUNGA, INFLASI, NILAI TUKAR RUPIAH DAN
UKURAN PERUSAHAAN TERHADAP *RETURN* SAHAM
PERUSAHAAN MANUFAKTUR SUB SEKTOR OTOMOTIF DAN
KOMPONEN YANG TERDAFTAR DI BEI**

Oleh

**Ketut Budi Arta, NIM 1617051091
Program Studi S1 Akuntansi
Jurusan Ekonomi dan Akuntansi**

ABSTRAK

Penelitian ini dilakukan untuk mengetahui pengaruh suku bunga, inflasi, nilai tukar rupiah, dan ukuran perusahaan terhadap return saham. Penelitian ini menggunakan pendekatan kuantitatif kausal. Populasi penelitian ini adalah perusahaan sektor otomotif dan komponen yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia yang berjumlah 13 perusahaan manufaktur sektor otomotif dan komponen yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Berdasarkan teknik purposive sampling, maka sampel penelitian ini berjumlah 12 perusahaan. Selanjutnya, data diolah dengan menggunakan bantuan program SPSS 20 dengan menguji uji statistik deskriptif, uji asumsi klasik yang terdiri dari pengujian normalitas, multikolinieritas, heteroskedastisitas dan autokorelasi, uji linier berganda yang meliputi dari pengujian t dan koefisien determinasi. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa Suku bunga tidak berpengaruh signifikan terhadap return saham. Inflasi berpengaruh negatif dan signifikan terhadap return saham. Nilai tukar rupiah berpengaruh positif dan signifikan terhadap return saham. Ukuran perusahaan berpengaruh positif dan signifikan terhadap return saham.

Kata Kunci: suku bunga, inflasi, nilai tukar rupiah, ukuran perusahaan, return saham

THE INFLUENCE OF INTEREST RATE, INFLATION, RUPIAH EXCHANGE RATE AND COMPANY SIZE ON STOCK RETURN OF AUTOMOTIVE AND COMPONENT MANUFACTURING COMPANIES LISTED ON THE IDX

By

*Ketut Budi Arta, NIM 1617051091
Undergraduate Study Program of Accounting
Department of Economics and Accounting*

ABSTRACT

This study was conducted to determine the effect of interest rates, inflation, rupiah exchange rate, and company size on stock returns. This study uses a causal quantitative approach. The population of this study is the automotive and component sector companies listed on the Indonesia Stock Exchange, totaling 13 automotive and component manufacturing companies listed on the Indonesia Stock Exchange. Based on the purposive sampling technique, the sample of this study amounted to 12 companies. Furthermore, the data was processed using the SPSS 20 program by testing descriptive statistical tests, classical assumption tests consisting of normality, multicollinearity, heteroscedasticity and autocorrelation tests, multiple linear tests which included t-test and coefficient of determination. The results of this study indicate that interest rates have no significant effect on stock returns. Inflation has a negative and significant effect on stock returns. The rupiah exchange rate has a positive and significant effect on stock returns. Firm size has a positive and significant effect on stock returns.

Keywords: interest rate, inflation, rupiah exchange rate, company size, stock re

