

ABSTRAK

ANALISIS FAKTOR –FAKTOR YANG MEMPENGARUHI RETURN SAHAM SEKTOR PERBANKAN YANG ADA DI BURSA EFEK INDONESIA TAHUN 2018-2021

NAMA : MARIA DEFIANA LURUK
NIM : 18190202
FAKULTAS : EKONOMI
PROGRAM STUDI : AKUNTANSI
TAHUN PENULISAN : 2022

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui dan memperoleh bukti secara empiris mengenai pengaruh inflasi dan tingkat suku bunga terhadap return saham pada perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) Periode 2017-2019.

Jenis data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data sekunder. Proses pemilihan sampel dalam penelitian ini yaitu perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2017-2019 sebanyak 40 perusahaan dengan jumlah periode pengamatan selama 3 tahun sehingga jumlah seluruh sample sebanyak 120 perusahaan.

Teknik analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah regresi linear berganda dengan bantuan program SPSS versi 26. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa secara parsial variabel inflasi tidak berpengaruh terhadap return saham sedangkan variabel tingkat suku bunga berpengaruh terhadap return saham. Secara simultan variabel inflasi dan tingkat suku bunga berpengaruh terhadap return saham. Kemudian koefisien determinasi (R^2) menunjukkan bahwa hanya 13,2% return saham dipengaruhi oleh variabel inflasi dan tingkat suku bunga.

Sedangkan sisanya 86,8% di pengaruh oleh variable lain yang tidak di teliti dalam penelitian ini, seperti kurs valuta asing, deposito laba usaha.

Kata Kunci : inflasi tingkat suku bunga dan return saham.