ABSTRAK

Hendro Wijonarko, Nomor Induk Mahasiswa 152130110, Program Studi Administrasi Bisnis Fakultas Ilmu Sosial dan Ilmu Politik Universitas Pembangunan Nasional "Veteran" Yogyakarta. Judul Penelitian Pengaruh Suku Bunga terhadap *Return* Saham dengan Kinerja Keuangan sebagai Variabel *Intervening* Inflasi, Studi Pada Perusahaan yang Termasuk dalam Indeks LQ 45 yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2012-2016. Dosen Pembimbing I : Bapak Indro Herry Mulyanto dan Dosen Pembimbing II : Bapak Hastho Joko N U.

Tujuan utama dari penelitian ini adalah untuk mengetahui pengaruh dari beberapa variabel suku bunga melalui kinerja keuangan terhadap *return* saham pada perusahaan-perusahaan yang termasuk dalam Indeks LQ 45 yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2012 s/d 2016. Populasi dari penelitian ini adalah semua perusahaan yang *listing* di Bursa Efek Indonesia (BEI) sekaligus termasuk dalam indeks LQ 45 periode 2012 s/d 2016 dan sampel penelitian adalah 22 perusahaan yang *listing* di BEI sekaligus yang konsisten berada di dalam indeks LQ 45. Pengambilan sampel adalah dengan *purposive sampling*. Tipe penelitian ini adalah tipe penelitian eksplanatif dengan teknis analisis jalur (*path*), kemudian uji t digunakan untuk mengetahui hasil hipotesis secara parsial, sedangkan uji F digunakan pengujian secara simultan.

Hasil dari penelitian ini menunjukan bahwa uji secara parsial menunjukkan bahwa suku bunga berpengaruh positif terhadap kinerja keuangan, kinerja keuangan berpengaruh negatif terhadap *return* saham, dan secara simultan suku bunga dengan kinerja keuangan berpengaruh terhadap *return* saham. Dengan hasil tersebut bagi pihak investor, hendaknya memperhatikan informasi mengenai variabel suku bunga dan kinerja keuangan berdasarkan Laporan Kinerja Tahunan (LKT) sehingga hasil *return* saham dalam bentuk *capital gain* dapat diraih dengan maksimal

Kata kunci : BI *rate*, kinerja keuangan, dan *return* saham