

ABSTRAKSI

Azzah Anggun Sari, Nomor Induk Mahasiswa 152140087, Program Studi Administrasi Bisnis, Fakultas Ilmu Sosial dan Ilmu Politik, Universitas Pembangunan Nasional “Veteran” Yogyakarta. Judul penelitian Pengaruh Inflasi, Tingkat Suku Bunga, Nilai Tukar Rupiah, dan Harga Minyak Dunia Terhadap Harga Saham Perusahaan yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia.

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh Inflasi, Tingkat Suku Bunga, Nilai Tukar Rupiah, dan Harga Minyak Dunia terhadap Harga Saham Perusahaan yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia baik secara parsial maupun secara simultan. Jenis penelitian ini adalah penelitian *explanatory*. Teknik pengambilan sampel menggunakan *proportionate stratified random sampling* dengan ukuran sampel 217 perusahaan yang terdiri dari sembilan sektor industri. Sampel pada penelitian ini adalah perusahaan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia tahun 2013 sampai tahun 2017. Teknik analisis yang digunakan adalah analisis regresi linear berganda dan uji hipotesis menggunakan uji t secara parsial, uji F secara simultan dengan *level of significance 5%*.

Hasil dari penelitian secara parsial menunjukkan bahwa Inflasi secara parsial berpengaruh signifikan terhadap harga saham perusahaan sektor pertanian, sektor pertambangan, sektor industri dasar dan kimia, sektor properti dan *real estate*, sektor transportasi dan infrastruktur, sektor perdagangan, jasa dan investasi, serta berpengaruh terhadap seluruh sektor industri. Namun, inflasi tidak berpengaruh terhadap harga saham perusahaan sektor aneka industri, sektor industri barang, dan sektor keuangan. Tingkat suku bunga secara parsial

berpengaruh signifikan terhadap harga saham perusahaan sektor pertambangan, sektor industri dasar dan kimia, sektor aneka industri, sektor industri barang konsumsi, dan sektor keuangan. Namun, tingkat suku bunga tidak berpengaruh terhadap harga saham perusahaan sektor pertanian, sektor properti dan *real estate*, sektor transportasi dan infrastruktur, sektor perdagangan, jasa, dan investasi, serta tidak berpengaruh terhadap seluruh sektor industri. Nilai tukar rupiah secara parsial berpengaruh signifikan terhadap harga saham perusahaan sektor industri barang konsumsi, sektor properti dan *real estate*, sektor transportasi dan infrastruktur, sektor keuangan, sektor perdagangan, jasa, dan investasi, serta berpengaruh seluruh sektor industri. Namun, nilai tukar rupiah tidak berpengaruh terhadap harga saham perusahaan sektor pertanian, sektor pertambangan, sektor industri dasar dan kimia, serta sektor aneka industri. Harga minyak dunia secara parsial berpengaruh terhadap harga saham perusahaan sektor industri dasar dan kimia, serta sektor barang konsumsi. Namun, harga minyak dunia tidak berpengaruh terhadap harga saham perusahaan sektor pertanian, sektor pertambangan, sektor aneka industri, sektor properti dan *real estate*, sektor transportasi dan infrastruktur, sektor keuangan, sektor perdagangan, jasa, dan investasi serta tidak berpengaruh terhadap seluruh sektor industri.

Hasil penelitian secara simultan menunjukkan bahwa inflasi, tingkat suku bunga, nilai tukar rupiah, dan harga minyak secara simultan dunia berpengaruh signifikan terhadap harga saham masing-masing sektor maupun keseluruhan sektor industri perusahaan baik sektor pertanian, sektor pertambangan, sektor industri dasar dan kimia, sektor aneka industri, sektor barang konsumsi, sektor

properti dan *real estate*, sektor transportasi dan infrastruktur, sektor keuangan, sektor perdagangan, jasa, dan investasi, serta seluruh sektor industri.

Kata Kunci: Inflasi, Tingkat Suku Bunga, Nilai Tukar Rupiah, Harga Minyak Dunia, Harga Saham