

## ABSTRAK

Fitriana, Lailatul 2019. Skripsi. **Pengaruh Suku Bunga BI Rate, Inflasi dan Nilai Tukar Rupiah/US Dollar Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Makanan-Minuman yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) Periode 2015-2018.** Program Studi Akuntansi, Fakultas Ekonomi, Universitas Panca Marga Probolinggo.

Penelitian dilakukan terhadap Perusahaan Makanan-Minuman yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2015-2018 dengan tujuan untuk mengetahui seberapa besar risiko yang akan ditanggung oleh investor atas *return* yang diperoleh. Penelitian dilakukan untuk mengetahui pengaruh suku bunga, inflasi dan nilai tukar terhadap *Return Saham*.

Jenis penelitian yang digunakan adalah kuantitatif, dengan variabel bebas (Variabel Independen) dan Variabel terikat (Variabel Dependen). Terdapat 8 Perusahaan yang telah dipilih sebagai sampel dengan teknik *Purposive Sampling*. Metode Pengumpulan data dengan dokumentasi menggunakan data kuartal. Sumber data yang dilakukan dari Bank Indonesia, dan *Yahoo Finance*.

Hasil Penelitian menunjukkan suku bunga *BI rate* berpengaruh positif tidak signifikan terhadap *Return Saham* karena tipe investor sangat berminat dalam berinvestasi serta tingkat suku bunga *BI Rate* tidak dijadikan parameter dalam mengukur *Return Saham* pada perusahaan makanan-minuman. Inflasi berpengaruh negatif tidak signifikan terhadap *return* saham karena meskipun tinggi rendahnya tingkat inflasi masyarakat tetap mengkonsumsi makanan-minuman dalam kehidupan sehari-hari sehingga meskipun inflasi mengalami peningkatan atau penurunan, keuangan perusahaan masih tetap berjalan sehingga tidak mempengaruhi *return* saham yang diperoleh oleh investor. Nilai Tukar Rupiah/US Dollar berpengaruh positif tidak signifikan terhadap *Return Saham*, melemahnya nilai Tukar Rupiah/US Dollar akibat dari kebijakan pemerintah dengan tujuan untuk mendorong daya tarik beli terhadap permintaan barang yang diproduksi dalam negeri sehingga memberikan keuntungan bagi perusahaan yang akan berdampak pada *return* yang diperoleh tinggi.

**Kata Kunci:** Suku Bunga *BI Rate*, Inflasi dan Nilai Tukar Rupiah/US Dollar.