

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh inflasi dan suku bunga terhadap *return* saham. Populasi dalam penelitian ini adalah 13 perusahaan industri sub sektor otomotif dan komponennya. Sampel yang dipergunakan adalah sebanyak 5 perusahaan. Metode penarikan sampel menggunakan metode *purposive sampling*. Metode pengumpulan data menggunakan metode *desk research*. Metode analisis data menggunakan metode uji stasioneritas dan uji regresi data panel dengan menggunakan aplikasi statistik Eviews 10 . Penelitian ini membuktikan bahwa inflasi berpengaruh negatif dan tidak signifikan terhadap *return* saham. Suku bunga berpengaruh positif dan tidak signifikan terhadap *return* saham.

Kata Kunci : Inflasi, Suku Bunga, *Return* Saham, *Eviews 10*.



ABSTRACT

This study aims to analyze the effect of inflation and interest rates on stock returns. The population in this study were 13 industrial companies in the automotive sub-sector and its components. The sample used is 5 companies. The sampling method uses a purposive sampling method. The method of data collection uses the desk research method. Data analysis method uses stationarity test method and panel data regression test with using Eviews 10 statistics application. This study proves that inflation does not effect on stock returns. Interest rates have a positive and insignificant effect on stock returns.

Keywords: Inflation, Interest Rates, Stock Returns, Eviews 10.

