

**PENGARUH NILAI TUKAR RUPIAH, INFLASI, DAN PENDAPATAN
MASYARAKAT TERHADAP HARGA SAHAM PERUSAHAAN SEKTOR
OTOMOTIF DAN KOMPONEN YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK
INDONESIA TAHUN 2013-2017**

Oleh:
Rizqi Dwi Rahayu

Di bawah bimbingan:
Dr. Dito Rinaldo, SE., MM.

ABSTRAK

Naik turunnya harga saham dipengaruhi oleh kondisi makro dan mikro. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh nilai tukar rupiah, inflasi, pendapatan masyarakat terhadap harga saham. Sampel yang digunakan pada penelitian yaitu perusahaan sektor otomotif dan komponen yang terdaftar di bursa efek indonesia tahun 2013-2017. Metode yang digunakan pada penelitian ini adalah metode deskriptif dan metode verifikatif. Data yang digunakan adalah data sekunder dengan menggunakan metode analisis regresi linier data panel.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa secara parsial nilai tukar rupiah berpengaruh positif signifikan terhadap harga saham, inflasi berpengaruh negatif signifikan terhadap harga saham, sedangkan pendapatan masyarakat tidak berpengaruh positif dan tidak signifikan terhadap harga saham. Berdasarkan hasil tersebut maka perusahaan harus mengambil beberapa kebijakan untuk mengatasi nilai tukar rupiah dengan membatasi penggunaan pada beberapa item barang yang dibutuhkan agar nilai tukar rupiah menguat dan untuk mengatasi inflasi dengan cara mengurangi biaya produksi agar tingkat inflasi dapat menurun, sehingga harga saham meningkat.

Kata Kunci: Nilai Tukar Rupiah, Inflasi, Pendapatan Masyarakat, Harga Saham

***EFFECT OF EXCHANGE RATE, INFLATION, AND COMMUNITY
INCOME ON STOCK PRICES IN AUTOMOTIVE SECTOR COMPANY AND
COMPONENTS LISTED IN INDONESIA STOCK EXCHANGE YEAR 2013-
2017***

Written by:
Rizqi Dwi Rahayu

Preceptor by:
Dr. Dito Rinaldo, SE., MM.

ABSTRACT

Fluctuations in stock prices are influenced by macro and micro conditions. This study aims to determine the effect of rupiah exchange rate, inflation, community income on stock prices. The sample used in the research is the automotive sector and component companies listed on the Indonesia stock exchange in 2013-2017. The method used in this research is descriptive method and verification method. The data used is secondary data using the panel data linear regression analysis method.

The results of this study indicate that partially the rupiah exchange rate has a significant positive effect on stock prices, inflation has a significant negative effect on stock prices, while community income does not have a positive and not significant effect on stock prices. Based on these results, the company must take several policies to overcome the rupiah exchange rate by limiting the use of some items needed to strengthens the rupiah exchange rate and to overcome inflation by reducing production costs so that the inflation rate can decrease, so that stock prices increase.

Keyword: Rupiah Exchange Rate, Inflation, and Community Income, Stock Price