

Skripsi Sarjana  
Program Studi Manajemen  
Semester Ganjil 2012/2016

**ANALISIS PENGARUH *EARNING PER SHARE*, UKURAN PERUSAHAAN, NILAI TUKAR, SUKU BUNGA, DAN INFLASI TERHADAP *RETURN* SAHAM PADA PERUSAHAAN SEKTOR KEUANGAN YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK INDONESIA PERIODE 2012-2016**

NPM: 1441143  
Devina Wistiasari

**Abstrak**

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk menguji pengaruh *earnings per share*, ukuran perusahaan, nilai tukar, suku bunga, dan inflasi terhadap variabel dependen berupa *return* saham pada perusahaan sektor keuangan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2012-2016.

Penelitian ini menggunakan metode *purposive sampling*, karena sampel yang diambil memiliki kriteria data yang diperlukan. Objek penelitian ini merupakan perusahaan-perusahaan yang bergerak disektor keuangan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia dengan periode penelitian dari tahun 2012 sampai dengan 2016.

Hasil dari penelitian ini menyebutkan bahwa terdapat pengaruh signifikan positif antara nilai tukar, dan inflasi terhadap *return* saham. Sedangkan pada variabel suku bunga ditemukan pengaruh signifikan negatif terhadap *return* saham. Selain itu, ditemukan bahwa ukuran perusahaan dan *earning per share* tidak memiliki pengaruh terhadap *return* saham. Dapat diambil kesimpulan bahwa nilai tukar, suku bunga, dan inflasi mempengaruhi pengembalian saham pada perusahaan sektor keuangan, sehingga para investor harus memperhatikan faktor-faktor tersebut.

**Kata kunci:** *return* saham, *earning per share*, ukuran perusahaan, nilai tukar, suku bunga, inflasi, perusahaan keuangan