

ABSTRAK

Ardina Nusravia 2017 : Pengaruh Suku Bunga Bank, Pertumbuhan Ekonomi, Nilai Mata Uang dan Profitabilitas (ROA) Terhadap *Return* Saham pada Indeks LQ 45 Periode 2011 – 2015. Dosen Pembimbing : Dr. Sparta.SE.Ak.,CA.ME

Tujuan dari penelitian ini adalah : menganalisa apakah terdapat pengaruh Suku Bunga Bank (SBI), Pertumbuhan Ekonomi (PDB), Nilai Mata Uang (Kurs) dan Profitabilitas (ROA) terhadap *return* saham pada indeks LQ45 periode 2011 – 2015. Data yang digunakan merupakan data sekunder yang didapatkan dari website Bank Indonesia, Website Bloomberg.com dan Laporan Keuangan. Pengambilan sample dalam penelitian sebanyak 22 emiten yang tidak bergeser dalam perhitungan LQ45 selama tahun penelitian yaitu lima tahun. Analisis dalam penelitian ini merupakan analisis data panel dengan pendekatan *fixed effect*. Hasil dari pendekatan tersebut terbukti bahwa SBI, PDB, Kurs dan ROA berpengaruh terhadap *return* saham pada indeks LQ45 2011-2015. Secara Parsial Kurs dan ROA berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham LQ45, Berbeda dengan Kurs yang tidak signifikan terhadap *Return* saham, sedangkan PDB dan tidak signifikan terhadap *return* saham LQ45.

Kata Kunci : *Return* saham, LQ45, SBI, Kurs, PDB, ROA.