

ABSTRAK

Sektor barang konsumsi adalah sektor penyumbang GDP paling besar di Indonesia. Meskipun gejolak ekonomi terus bergerak, sektor barang konsumsi tetap dapat mempertahankan posisinya dalam hal GDP. Penelitian ini dilakukan untuk menganalisis pengaruh dari tingkat suku bunga, inflasi, dan nilai tukar Rupiah terhadap Dollar Amerika terhadap *return* saham perusahaan LQ45 sektor barang konsumsi pada tahun 2010-2014 dengan menggunakan metode regresi *linear* berganda. Penelitian ini menggunakan data yang telah diterbitkan oleh masing-masing perusahaan yang menjadi objek penelitian dan data yang diterbitkan oleh Badan Pusat Statistik dan Bank Indonesia dalam bentuk bulanan.

Metode yang digunakan dalam penelitian ini adalah metode kuantitatif dan jenis penelitian ini adalah deskriptif verifikatif kausal dengan pendekatan berupa pengolahan data statistik. Selanjutnya, teknik sampling yang digunakan dalam penelitian ini adalah *purposive sampling*. Analisis dilakukan dengan menggunakan regresi *linear* berganda dan koefisien determinasi.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa nilai *return* saham perusahaan LQ45 sektor industri barang konsumsi tidak dipengaruhi secara signifikan oleh tingkat suku bunga, inflasi, dan nilai tukar Rupiah terhadap Dollar Amerika, baik secara simultan maupun parsial.

Kata Kunci: Tingkat Suku Bunga, Inflasi, Nilai Tukar, *Return* Saham.