

ABSTRAK

KHAFIFAH PAJRIANTI. 021121095. Pengaruh Inflasi, Suku Bunga dan Nilai Tukar terhadap Indeks Harga Saham Sektor Keuangan Periode 2019-2023. Di bawah bimbingan: HERDIYANA dan ABEL GANDHY. 2025.

Indeks harga saham mencerminkan harga sejumlah saham yang dipilih dan dievaluasi secara berkala berdasarkan metode dan kriteria tertentu. Sektor keuangan memegang peran penting dalam perekonomian dan menjadi penggerak pertumbuhan di sektor riil. Hampir semua negara mendorong peningkatan sektor keuangan untuk meningkatkan perekonomian dan tidak lepas dari lingkup makro ekonomi. Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh variabel makro ekonomi seperti inflasi, suku bunga dan nilai tukar terhadap indeks harga saham sektor keuangan periode 2019-2023.

Jenis penelitian yang digunakan yaitu penelitian verifikatif dengan metode penelitian *explanatory survey*. Dalam penelitian ini, objek penelitian yang digunakan yaitu Inflasi (INF_1), Suku Bunga (SBI_2), Nilai Tukar (NT_3), dan Indeks Harga Saham. Unit analisis penelitian ini adalah data dari Indeks Harga Saham Sektor Keuangan (IHSK) atau Indeks Keuangan (JKFINA). Jenis data penelitian yang digunakan adalah data kuantitatif dan sumber data pada penelitian ini adalah data sekunder berupa data *time series*. Sedangkan metode analisis data yang digunakan yaitu analisis regresi linier berganda. Dengan bantuan software SPSS 26.

Hasil dari penelitian ini secara parsial menunjukkan bahwa inflasi berpengaruh positif terhadap indeks harga saham sektor keuangan periode 2019-2023, Suku bunga berpengaruh negatif terhadap indeks harga saham sektor keuangan periode 2019-2023, Nilai tukar tidak berpengaruh terhadap indeks harga saham sektor keuangan periode 2019-2023. Secara simultan menunjukkan bahwa inflasi, suku bunga dan nilai tukar berpengaruh terhadap indeks harga saham sektor keuangan periode 2019-2023.

Kata kunci: Inflasi, Suku Bunga, Nilai Tukar, Indeks Harga Saham Sektor Keuangan