

LAPORAN SKRIPSI

ANALISIS PENGARUH HARGA EMAS DUNIA, HARGA MINYAK DUNIA, VALUTA ASING, DAN INFLASI TERHADAP RETURN SAHAM YANG TERGABUNG PADA LQ-45 PERIODE 2020-2022



UNIVERSITAS KATOLIK SOEGIJAPRANATA SEMARANG

2024

ANALISIS PENGARUH HARGA EMAS DUNIA, HARGA MINYAK DUNIA, VALUTA ASING, DAN INFLASI TERHADAP *RETURN SAHAM* YANG TERGABUNG PADA LQ-45 PERIODE 2020-2022

SKRIPSI

Diajukan untuk memenuhi syarat guna mencapai gelar Sarjana pada

Program Studi Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis

Universitas Katolik Soegijapranata

Nama : Ruben Julianus Riyadi

NIM : 20.D1.0208

Dosen Pembimbing :

Eny Trimeiningrum, SE., MSi

PROGRAM STUDI MANAJEMEN

FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS

UNIVERSITAS KATOLIK SOEGIJAPRANATA SEMARANG

2024

ABSTRAK

Pada masa globalisasi sekarang ini, kebutuhan manusia tidak hanya terfokus pada kebutuhan jangka pendek, namun juga kepada kebutuhan jangka panjang. Salah satu upaya untuk dapat memenuhi kebutuhan jangka panjang ini adalah dengan melakukan investasi. Salah satu jenis investasi yang banyak diminati investor adalah investasi saham. Investasi saham dapat dilakukan dalam sebuah media yaitu pasar modal, dalam melakukan investasi saham, para investor dapat memperhatikan beberapa indeks saham yang telah tersedia dalam Bursa Efek Indonesia, salah satunya yaitu Indeks LQ-45. Indeks tersebut menyediakan tingkat harga dan juga *return* dari saham-saham yang tergabung dalam indeks. Untuk itu peneliti melakukan studi kasus dengan topik ini untuk membantu para investor mengetahui faktor-faktor ekonomi apa saja yang mempengaruhi *return* dari saham-saham yang tergabung dalam indeks LQ-45 periode 2020-2022.

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh harga emas dunia, harga minyak dunia, valuta asing, dan inflasi terhadap *return* saham yang tergabung dalam indeks LQ-45 pada periode 2020-2022. Data yang digunakan merupakan data sekunder yang diperoleh dari sumber-sumber terpercaya selama periode penelitian. Penelitian ini dilakukan dengan menggunakan uji deskriptif, uji asumsi klasik, dan uji hipotesis menggunakan analisis regresi linier berganda, uji t parsial, dan uji koefisien regresi. Hasil dari uji tersebut adalah 1) Harga emas dunia memiliki pengaruh positif terhadap *return* saham LQ-45 periode 2020-2022, 2) Harga minyak memiliki pengaruh positif terhadap *return* saham LQ-45 periode 2020-2022, 3) Valuta asing atau nilai tukar tidak memiliki pengaruh terhadap *return* saham LQ-45 periode 2020-2022, 4) Inflasi tidak memiliki pengaruh terhadap *return* saham LQ-45 periode 2020-2022.

Kata Kunci : Harga Emas, Harga Minyak, Valuta Asing, Inflasi, *Return*, Indeks LQ-45, Saham