

ABSTRAK

Indikator keberhasilan ekonomi adalah kinerja ekonomi makro. Faktor ekonomi makro ini dapat mempengaruhi kegiatan industri, perusahaan dan juga pasar modal. Pada tahun 2016-2021 pertumbuhan ekonomi seluruh dunia mengalami penurunan yang cukup parah, khususnya pada tahun 2019 akibat munculnya pandemi Covid 19, salah satu sektor yang mengalami fluktuasi adalah sektor barang konsumsi, harga saham perusahaan juga mengalami fluktuasi.

Penelitian ini menganalisis pengaruh variabel ekonomi makro seperti inflasi, suku bunga dan nilai tukar terhadap return saham suatu perusahaan. Sampel yang digunakan dalam penelitian ini adalah data dari PT Unilever Indonesia Tbk periode 2016-2021. Metode analisis yang digunakan adalah metode kuantitatif dengan menggunakan analisis deskriptif dan analisis regresi linier berganda.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa secara simultan variabel inflasi, suku bunga dan nilai tukar berpengaruh terhadap return PT Unilever Indonesia Tbk, secara parsial inflasi dan nilai tukar juga berpengaruh terhadap return saham, sedangkan suku bunga tidak berpengaruh signifikan terhadap return saham secara parsial, Implikasi Dari temuan tersebut, investor dapat memanfaatkan penelitian ini sebagai referensi untuk penelitian selanjutnya dengan menggunakan variabel lain yang dapat mempengaruhi return saham suatu perusahaan dan juga menggunakan objek yang berbeda.

Kata Kunci : Faktor Makroekonomi, Return Saham, Inflasi, Suku Bunga, Nilai Tukar.