

ABSTRAK

Sri Nanang Lasaguni, NIM 261 408 121 2012. “ Pengaruh Suku Bunga Sertifikat Bank Indonesia Terhadap Return Saham PT. HM. Sampoerna, Tbk”. Skripsi, Program Studi S – 1 Manajemen Jurusan Manajemen, Fakultas Ekonomi dan Bisnis, Universitas Negeri Gorontalo. Dibawah bimbingan **Dr. H. Rosman Iato, M.Pd** selaku pembimbing 1 dan **Moh.Agussalim Monoarfa, SE,MM** selaku pembimbing II.

Penelitian ini didasarkan pada rumusan masalah yaitu Apakah perubahan *Suku Bunga Sertifikat Bank Indonesia* berpengaruh terhadap *Return Saham PT. HM. Sampoerna, Tbk*. Metode yang digunakan dalam penelitian ini adalah metode kuantitatif. Metode ini digunakan untuk menganalisis pengaruh variabel X (*Tingkat Suku Bunga Sertifikat Bank Indonesia*) terhadap variable Y (*Return Saham*). Instrument yang digunakan adalah data sekunder serta untuk menganalisis data digunakan analisis regresi sederhana.

Berdasarkan hasil penelitian maka dapat dikemukakan kesimpulan bahwa terdapat pengaruh antara *Suku Bunga SBI* terhadap *Return Saham PT. HM. Sampoerna, Tbk* dengan hasil uji diperoleh persamaan regresi linier yaitu $\hat{y} = 11,575 + 1,152X$ dan variabel *Suku Bunga SBI* memiliki koefisien regresi bertanda positif sebesar 0.589 artinya apabila terjadi perubahan variabel *Suku Bunga SBI* akan mempengaruhi *Return Saham* sebesar 58,9%. Serta sisanya sebesar 41,1% dipengaruhi oleh faktor-faktor lain yang tidak termasuk dalam penelitian ini seperti *Dividend Per Share, Earning per share, Return On Investment, Return On Equity* serta *rasio-rasio keuntungan lainnya*, dapat pula dipengaruhi oleh faktor-faktor seperti perubahan nilai mata uang (kurs valuta asing), inflasi, gejolak sosial politik, besarnya investasi, dan berbagai *issue* baik dari dalam dan luar negeri.. Adapun pengujian hipotesis dilakukan dengan membandingkan nilai *t hitung* dan *t tabel*. Dimana $t \text{ hitung} > t \text{ tabel}$ ($3,075 > 2,776$).

Kata Kunci : *Suku Bunga Sertifikat Bank Indonesia, Return Saham*