

**PENGARUH PERUBAHAN NILAI TUKAR RUPIAH TERHADAP
HARGA SAHAM PT. ASTRA INTERNATIONAL Tbk. DAN PT.
INDOFOOD SUKSES MAKMUR Tbk.**

SKRIPSI

**Untuk Memenuhi Salah Satu Syarat
Guna Mencapai Gelar Sarjana Ekonomi**



Oleh:

VINSKY ARINDA

19220017

MANAJEMEN

FAKULTAS EKONOMI

UNIVERSITAS IBA

PALEMBANG

2023

SKRIPSI

**PENGARUH PERUBAHAN NILAI TUKAR RUPIAH TERHADAP
HARGA SAHAM PT. ASTRA INTERNATIONAL Tbk. DAN PT.
INDOFOOD SUKSES MAKMUR Tbk.**

Dipersiapkan dan disusun oleh :

VINSKY ARINDA

19 22 0017

MANAJEMEN

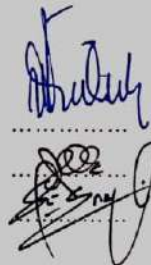
Telah Dipertahankan di Depan Tim Penguji

Pada Tanggal 27 Juni 2023

Dan dinyatakan Memenuhi Syarat

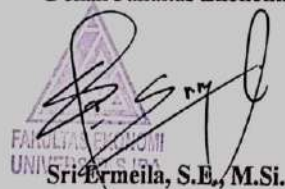
TIM PENGUJI

Ketua : Dr. Lily Rahmawati Harahap, S.E., M.M.
Anggota : Rahmi Aryanti, S.E., M.E.
Anggota : Sri Ermeila, S.E., M.Si.



Mengetahui

Dekan Fakultas Ekonomi,



Sri Ermeila, S.E., M.Si.



**FAKULTAS EKONOMI
UNIVERSITAS IBA
PALEMBANG**

TANDA PERSETUJUAN SKRIPSI

Nama Penyusun : VINSKY ARINDA
NPM : 19 22 0017
Program Studi : MANAJEMEN
Mata Kuliah Pokok : MANAJEMEN KEUANGAN
Judul Skripsi : "PENGARUH PERUBAHAN NILAI TUKAR
RUPIAH TERHADAP HARGA SAHAM PT.
ASTRA INTERNATIONAL Tbk. DAN PT.
INDOFOOD SUKSES MAKMUR Tbk"
Tanggal Persetujuan : Juni 2023

PEMBIMBING SKRIPSI

Ketua,

Dr. Lily Rahmawati Harahap, S.E., M.M.

Anggota,

Rahmi Aryanti, S.E., M.E.

Mengetahui

Dekan Fakultas Ekonomi,

Sri Ermeila, S.E., M.Si.

PERNYATAAN

Saya yang bertanda tangan dibawah ini :

Nama : VINSKY ARINDA
Tempat Tanggal Lahir : Suka Bumi, 30 Desember 2000
Program Studi : Manajemen
NPM : 19 22 0017

Menyatakan dengan sesungguhnya bahwa :

1. Seluruh data, informasi interpretasi serta pernyataan dalam pembahasan dan kesimpulan yang disajikan dalam karya ilmiah ini, kecuali yang disebutkan sumbernya, adalah merupakan hasil pengamatan, penelitian, pengelolaan, serta pemikiran saya dengan pengarahan dari para pembimbing yang ditetapkan.
2. Karya ilmiah yang saya tulis ini adalah asli dan belum pernah diajukan untuk mendapatkan gelar akademik, baik di Universitas IBA maupun di perguruan tinggi lainnya.

Dengan demikian pernyataan ini dibuat dengan sebenar-benarnya dan apabila dikemudian hari ditemukan adanya bukti ketidak benaran dalam pernyataan tersebut di atas, maka saya bersedia menerima sanksi akademis berupa pembatalan gelar yang saya peroleh melalui pengujian karya ilmiah ini.

Palimbang, 30 Juni 2023
Yang Membuat Pernyataan



VINSKY ARINDA
NPM : 19 22 0017

ABSTRAK

PENGARUH PERUBAHAN NILAI TUKAR RUPIAH TERHADAP HARGA SAHAM PT. ASTRA INTERNATIONAL Tbk. DAN PT. INDOFOOD SUKSES MAKMUR Tbk.

Oleh :

VINSKY ARINDA

Penulisan skripsi ini dibawah bimbingan :

Dr. Lily Rahmawati Harahap, S.E., M.M
Sebagai Ketua

Rahmi Aryanti, S.E., M.E.
Sebagai Anggota

Faktor makro ekonomi tentunya memiliki pengaruh yang sangat besar terhadap pergerakan harga saham di pasar modal Indonesia. Dari penelitian yang dilakukan terhadap variabel makro ekonomi seperti nilai tukar Rupiah terhadap dolar AS dan harga saham dapat berpengaruh secara positif maupun negatif. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui secara empiris pengaruh perubahan nilai tukar Rupiah terhadap harga saham pada PT. Astra International Tbk dan PT. Indofood Sukses Makmur Tbk. populasi yang digunakan dalam penelitian ini yaitu nilai tukar Rupiah dan harga saham perusahaan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI). Sampel yang digunakan pada penelitian ini adalah data harga saham PT. Astra International Tbk dan PT. Indofood Sukses Makmur Tbk periode 2019-2019 dan nilai tukar Rupiah terhadap dolar AS periode 2019-2022. Jenis data yang digunakan adalah data sekunder.

Metode pengumpulan data dalam penelitian ini menggunakan studi literatur dan studi dokumenter, teknik analisis yang digunakan adalah Uji Asumsi Klasik, Analisis Regresi Linier Sederhana, Koefisien Korelasi, Koefisien Determinasi (R^2), dan Uji Hipotesis. Dan data diolah dengan menggunakan statistik SPSS. Berdasarkan hasil penelitian menunjukkan bahwa (1) Dan dari hasil perhitungan uji t diperoleh nilai sig $0,024 < 0,05$ yang berarti nilai tukar Rupiah berpengaruh negatif terhadap harga saham PT.Astra International Tbk. (2) Dari hasil perhitungan uji t dengan membandingkan t_{hitung} dan t_{tabel} diperoleh bahwa $t_{hitung} 2,979 > t_{tabel} 1,679$ yang berarti nilai tukar Rupiah berpengaruh positif terhadap harga saham PT. Indofood Sukses Makmur Tbk.

Kata kunci : Nilai Tukar Rupiah, Harga Saham

ABSTRACT

THE EFFECT OF CHANGES IN THE RUPIAH EXCHANGE RATE ON THE SHARE PRICE OF PT. ASTRA INTERNATIONAL Tbk. AND PT. INDOFOOD SUKSES MAKMUR Tbk

By

VINSKY ARINDA

The writing of this thesis is under the guidance of :

Dr. Lily Rahmawati Harahap, S.E., M.M
As Chairman

Rahmi Aryanti, S.E., M.E.
As a Member

Macroeconomic factors certainly have a huge influence on stock price movements in the Indonesian capital market. From research conducted on macroeconomic variables such as the exchange rate of the Rupiah against the US dollar and stock prices can affect positively or negatively. This study aims to empirically determine the effect of changes in the Rupiah exchange rate on stock prices at PT. Astra International Tbk and PT. Indofood Sukses Makmur Tbk. population used in this study is the Rupiah exchange rate and share prices of companies listed on the Indonesia Stock Exchange (IDX). The sample used in this study is stock price data of PT. Astra International Tbk and PT. Indofood Sukses Makmur Tbk for the 2019-2019 period and the Rupiah exchange rate against the US dollar for the 2019-2022 period. The type of data used is secondary data.

The data collection method in this study uses literature studies and documentary studies, the analysis techniques used are Classical Assumption Test, Simple Linear Regression Analysis, Correlation Coefficient, Determination Coefficient (R^2), and Hypothesis Test. And the data is processed using SPSS statistic. Based on the results of the study shows that (1) And from the calculation results of the t test obtained a sig value of $0.024 < 0.05$ which means that the Rupiah exchange rate negatively affects the share price of PT. Astra International Tbk. (2) From the results of the t-test calculation by comparing t_{count} and t_{table} , it is obtained that $t_{calculate} 2,979 > t_{table} 1,679$ which means that the Rupiah exchange rate has a positive effect on the share price of PT. Indofood Sukses Makmur Tbk.

Keywords : Rupiah Exchange Rate, Stock Price