ABSTRAK

Cica Cunengsih, "Analisis Pengaruh Tingkat Suku Bunga SBI dan Nilai Tukar Rupiah/US Dollar terhadap *Return* Saham pada Perusahaan Perbankan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) Periode 2007-2011", di bawah bimbingan : Prof. Dr. Hj. Ria Ratna Ariawati, MS., Ak.

Tujuan penelitian ini yaitu untuk mengetahui : (1) Perkembangan Tingkat Suku Bunga SBI, Nilai Tukar Rupiah/US Dollar, dan *Return* Saham, (2) Pengaruh Tingkat Suku Bunga SBI dan Nilai Tukar Rupiah/US Dollar terhadap *Return* Saham, baik secara Simultan maupun Parsial**.**

Metode penelitian yang digunakan adalah metode deskriptif dan metode verifikatif. Data yang digunakan adalah data sekunder periode 2007-2011 yang meliputi perusahaan Perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Pengujian statistik yang digunakan adalah analisis regresi linier berganda, uji asumsi klasik, analisis korelasi Pearson, dan koefisien determinasi yang dihitung menggunakan aplikasi SPSS *20.0 for windows.*

Hasil penelitian menunjukkan bahwa Secara parsial variabel Tingkat Suku Bunga SBI memiliki pengaruh yang tidak signifikan terhadap *Return* Saham pada perusahaan Perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Sedangkan variabel Nilai Tukar Rupiah/US Dollar memiliki pengaruh signifikan terhadap *Return* Saham pada perusahaan Perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Secara simultan kedua variabel tersebut berpengaruh signifikan terhadap *Return* Saham sebesar 15,2% sedangkan 84,8% dipengaruhi oleh faktor lainnya.

Kata kunci : Tingkat Suku Bunga SBI, Nilai Tukar Rupiah/US Dollar, dan *Return* saham.