

Analisis pengaruh nilai tukar us dolla,tingkat inflansi tingkat suku bunga deposito, tingkat bunga SBI terhadap return indeks harga saham gabungan (HSG) dan return indeks LQ45 di bursa efek indonesia periode 2001 desember 2007

Simangusong, Laura Tonggouli Lasmaroha, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=120780&lokasi=lokal>

Abstrak

Investasi melalui pasar modal selain memberikan hasil, juga mengandung risiko. Besar kecilnya risiko di pasar modal sangat dipengaruhi oleh keadaan negara khususnya di bidang ekonomi, politik dan sosial. Tujuan penelitian untuk mengetahui pengaruh nilai tukar US Dollar, tingkat inflasi, tingkat suku bunga deposito, tingkat bunga Sertifikat Bank Indonesia (SBI) terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) dan Indeks LQ 45 di Bursa Efek Indonesia Periode 2001- Desember 2007. Metode penelitian yang digunakan meliputi uji asumsi klasik dan uji regresi (uji regresi sederhana dan uji regresi berganda). Pengumpulan data dilakukan dengan menggunakan nilai tukar US Dollar, tingkat inflasi, tingkat suku bunga deposito, tingkat bunga sertifikat bank Indonesia (SBI) diperoleh dari Laporan publikasi bulanan Bank Indonesia periode 2001-2007 dan Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) dan Indeks Harga Saham LQ 45 diperoleh dari Laporan publikasi bulanan Bursa Efek Indonesia periode 2001-2007. Data kemudian dibuat tabulasi untuk memudahkan dalam pengelompokan antar variabel. Data yang diperoleh selanjutnya dianalisis dengan menggunakan formula statistika, yakni uji regresi sederhana (uji-t) dan uji regresi berganda (uji-f) yang perhitungannya dilakukan dengan menggunakan bantuan program SPSS versi 15. Hasil pengujian secara simultan variabel nilai tukar US Dollar, tingkat inflasi, tingkat suku bunga deposito, tingkat bunga sertifikat bank Indonesia (SBI) terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) dan Indeks Harga Saham LQ 45 memiliki pengaruh signifikan. Variabel tingkat bunga sertifikat bank Indonesia (SBI) paling dominan terhadap Return Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) dan Return Indeks Harga Saham LQ 45.

.....Investing through the stock market takes a lot of risk The risk in stock market depends on the economic, politic, and social situation in this country. This research is to know how the effect of the US Dollar Currencies, Inflation Growth, Deposite Interest rate, SBI, against the IHSG and Index of LQ 45 in the Indonesia Stock Exchange in 2001 until December 2007. This research methodology consist of classic assumption test and regression analysis. Data collection includes US Dollar Currencies, inflation Growth, Deposite interest rate, SBI from Bank of Indonesia publication monthly report from 2001 until December 2007 and IHSG and LQ 45 Index from the publication monthly report of the Indonesia stock exchange in 2001 ~ 2007 with using the table to groups of variable. The data we analysis with formula statistic such as Regression simple test (t test) and regression double test (f test) with using SPSS Program version 15. The result from the US Dollar Currencies variable, Inflation growth, Deposite interest rate, SBI against IHSG and LQ 45 index it has significant influences. Interest rate certificate of Bank Indonesia (SBI) is the most dominant to IHSG and LQ 45 Index stock price.