

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar UIN Suska Riau.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin UIN Suska Riau.

ABSTRAK

PENGARUH TINGKAT SUKU BUNGA SBI, TINGKAT INFLASI, NILAI TUKAR RUPIAH (USD), INDEKS SAHAM DOW JONES (DJIA), INDEKS STRAIT TIMES (STI) DAN NIKKEI 225 TERHADAP INDEKS HARGA SAHAM GABUNGAN DI BURSA EFEK INDONESIA (PERIODE 2010-2016)

Oleh:

REGI ARNANDES PRATAMA
NIM.11371102330

Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) merupakan cerminan perekonomian Indonesia, saat IHSG menunjukkan peningkatan berarti perekonomian Indonesia berada dalam keadaan yang kondusif dan sebaliknya. Pergerakan IHSG dipengaruhi banyak faktor, baik internal maupun eksternal diantaranya suku bunga SBI, inflasi, nilai tukar, Indeks Dow Jones, Indeks Strait Times dan Indeks Nikkei 225. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh tingkat suku bunga SBI, tingkat inflasi, nilai tukar rupiah (USD), indeks Dow Jones (DJIA), indeks Strait Times (STI) dan indeks Nikkei 225 terhadap Indeks Harga Saham Gabungan di Bursa Efek Indonesia periode 2010-2016. Teknik pengambilan sampel yang digunakan dalam penelitian ini adalah metode purposive sampling yaitu teknik penentuan sampel dengan beberapa pertimbangan tertentu agar lebih representatif. Teknik analisis data yang digunakan untuk memecahkan permasalahan ini adalah analisis regresi linier berganda dengan bantuan program SPSS 23. Berdasarkan hasil penelitian menunjukkan bahwa perhitungan hipotesis secara parsial suku bunga SBI, inflasi, nilai tukar, indeks Strait Times dan indeks Nikkei 225 tidak berpengaruh signifikan terhadap IHSG hal itu dapat dilihat dengan tingkat signifikansi sebesar $0,341 > 0,05$, $0,748 > 0,05$, $0,127 > 0,05$, $0,216 > 0,05$, dan $0,218 > 0,05$. Sedangkan indeks Dow Jones berpengaruh signifikan positif terhadap IHSG dengan tingkat signifikansi sebesar $0,000 < 0,05$. Untuk hasil pengujian secara simultan diperoleh $F_{hitung} > F_{tabel} = 100,975 > 2,21882$ berarti hipotesis secara simultan antara suku bunga SBI, tingkat inflasi, nilai tukar rupiah (USD), indeks Dow Jones (DJIA), indeks Strait Times (STI) dan Nikkei 225 berpengaruh terhadap IHSG. Dari hasil penelitian ini juga diperoleh Koefisien Determinasi (R^2) dengan nilai 0,887 atau 88,7% yang berarti bahwa IHSG dapat dipengaruhi oleh tingkat suku bunga SBI, tingkat inflasi, nilai tukar rupiah (USD), indeks Dow Jones (DJIA), indeks Strait Times (STI) dan Nikkei 225 sebesar 88,7% sedangkan 11,3% sisanya merupakan varian yang tidak dijelaskan dalam penelitian ini.

Kata Kunci: *Tingkat Suku Bunga SBI, Tingkat Inflasi, Nilai Tukar Rupiah(USD), Indeks Saham Dow Jones (DJIA), Indeks Strait Times (STI), Nikkei 225 dan Indeks Harga Saham Gabungan*