

**PENGARUH BUNGA DEPOSITO DAN KURS RUPIAH
PER DOLLAR AS TERHADAP INDEKS HARGA
SAHAM GABUNGAN DI BEJ PERIODE
TAHUN 2010 - 2012**



**UNIVERSITAS
MERCU BUANA**

SKRIPSI

Diajukan Untuk Memenuhi Tugas dan Syarat – Syarat Guna Memperoleh Gelar
Sarjana Ekonomi pada Fakultas Ekonomi dan Bisnis Jurusan Manajemen

Universitas MercuBuana Jakarta

UNIVERSITAS

Oleh

MERCU BUANA

TITIN HARTINAH

43108110144

FAKULTAS EKONOMI & BISNIS

UNIVERSITAS MERCU BUANA

JAKARTA

2013

SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI

Yang bertanda tangan di bawah ini :

Nama : Titin Hartinah

NIM : 43108110144

Program Studi : Manajemen

Menyatakan bahwa skripsi ini adalah murni hasil karya sendiri. Apabila saya mengutip dari karya orang lain, maka saya mencantumkan sumbernya sesuai dengan ketentuan yang berlaku. Saya bersedia dikenai sanksi pembatalan skripsi ini apabila terbukti melakukan tindakan plagiat (penjiplakan).

Demikian pernyataan ini saya buat dengan sebenarnya.

Jakarta, Maret 2013



Titin Hartinah

NIM : 43108110144

LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI

Nama : Titin Hartinah

NIM : 43108110144

Program Studi : S1 Manajemen

Judul Skripsi : **Pengaruh Bunga Deposito dan Kurs rupiah per Dollar AS terhadap Indeks Harga Saham Gabungan di BEJ periode tahun 2010 - 2012**

Tanggal Lulus Ujian :

Disahkan Oleh :

Pembimbing Skripsi



(Sahibul Munir, SE.M.Si)

Dekan,

Manajemen S1



(Dr. Wiwik Utami, Ak, M.Si)

Ketua Program Studi



(Dr. Rina Astini, MM)

LEMBAR PENGESAHAN DEWAN PENGUJI

Skripsi

Pengaruh Bunga Deposito dan Kurs rupiah per Dollar AS terhadap Indeks
Harga Saham Gabungan di BEJ periode tahun 2010 - 2012

Dipersiapkan dan Disusun Oleh :

Titin Hartinah

43108110144

Telah dipertahankan di depan Dewan penguji pada tanggal

Susunan Dewan Penguji

Ketua Penguji/Pembimbing Skripsi



(Sahibul Munir, SE.M.Si)

Anggota Dewan Penguji



(Dra. Aty Herawati M.Si)

Anggota Dewan Penguji



(Luna Haningsih. SE.ME)

KATA PENGANTAR

Puji syukur penulis panjatkan atas kehadiran Allah SWT atas rahmat-Nya sehingga penulis dapat menyelesaikan skripsi ini. Adapun penulisan ini bertujuan untuk memenuhi salah satu syarat dalam memperoleh gelar Sarjana pada Fakultas Ekonomi dan Bisnis di Universitas Mercu Buana, Jakarta.

Selama proses penyusunan skripsi ini penulis mendapatkan bimbingan, arahan, bantuan dan dukungan dari berbagai pihak. Oleh karena itu, dalam kesempatan ini penulis mengucapkan terima kasih kepada :

1. Bapak Dr. Arisetyanto Nugroho, MM, selaku Rektor Universitas Mercu Buana.
2. Ibu Dr. Wiwik Utami, Ak, M.Si selaku Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Mercu Buana.
3. Ibu Dr. Rina Astini, MM selaku Ketua Program Studi Manajemen Strata 1 Universitas Mercu Buana.
4. Bapak Sahibul Munir, SE.M.Si selaku dosen pembimbing yang telah bersedia memberikan bimbingan dan pengarahan dalam penulisan skripsi ini.
5. Seluruh dosen dan segenap staff Universitas Mercu Buana atas ilmu dan bantuan yang telah diberikan

6. Kepada Suami dan anak2 tercinta yang selalu memberikan doa, dorongan, dan semangatnya kepada penulis. Kalian tak akan pernah tergantikan oleh apapun.
7. Kepada Indra Wibowo, Ibnu Sina M, Hanna K, Rekan kerja serta saudara - saudara semua yang tak hentinya memberikan semangat serta dorongan yang luar biasa.
8. Teman-teman seperjuangan di kampus, Feri Kristianty, Dian Mulyani, Winda Sari, Putri, Mutsalis R yang telah memberikan kenangan manis, dukungan serta solidaritasnya kepada penulis sehingga skripsi ini dapat terselesaikan.
9. Seluruh pihak yang tidak dapat disebutkan satu persatu, terimakasih atas segala bantuan dan informasi yang diberikan kepada penulis dalam menyelesaikan skripsi ini.

Semoga Allah SWT memberikan pahala dan balasan yang berlipat ganda atas amal dan budi baik semua pihak tersebut diatas. Semoga skripsi ini bermanfaat dan dapat digunakan sebagai tambahan informasi dan wacana bagi semua pihak yang membutuhkan.

Jakarta, Maret 2013

Penulis

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMPUL.....	i
HALAMAN JUDUL	ii
HALAMAN PERNYATAAN KARYA SENDIRI	iii
HALAMAN PENGESAHAN PEMBIMBING SKRIPSI	iv
HALAMAN PENGESAHAN DEWAN PENGUJI	v
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xvi
ABSTRAK	xvii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Perumusan Masalah.....	5
1.3 Batasan Masalah	5
1.4 Kerangka Pemikiran	6
1.5 Hipotesis.....	7
1.6 Metode Penelitian	7
1.7 Tujuan Penelitian.....	8
1.8 Manfaat Penelitian	8
1.8.1 Kegunaan Pengembangan Ilmu	9

BAB II	LANDASAN TEORI	10
2.1	Tingkat Suku Bunga	10
2.1.1	Pengertian Suku Bunga.....	10
2.1.2	Pengertian Deposito Berjangka	11
2.1.3	Penjelasan BI Rate sebagai Suku Bunga	
	Acuan	13
2.2	Kurs Mata Uang	14
2.2.1	Pengertian Valas.....	13
2.2.2	Pengertian Kurs.....	15
2.2.3	Sistem Kurs Valas	17
2.2.4	Jenis Kurs	18
2.2.5	Cara-cara Pengendalian Kurs Valas	19
2.2.6	Faktor-Faktor yang mempengaruhi Kurs Valas.....	20
2.3	Indeks Harga Saham.....	21
2.3.1	Pengertian Indeks Harga Saham.....	21
2.3.2	Faktor – faktor yang mempengaruhi IHSG	23

BAB III	METODOLOGI PENELITIAN	24
3.1	Sejarah dan Perkembangan Bursa Efek Jakarta.....	26
3.1.1.	Secara singkat, tonggak perkembangan pasar modal di Indonesia dapat dilihat sebagai berikut:	
3.2	Teknik Pengolahan Data	29
3.3	Variabel Penguji.....	29
3.4	Teknik Analisa Data.....	30
3.4.1	Analisi Korelasi	30
3.4.2.	Analisis Regresi Berganda	31
3.4.3.	Asumsi – asumsi Klasik	32
3.4.3.1	Uji Autokorelasi	33
3.4.3.2	Uji Multikolinieritas.....	33
3.4.3.3	Uji Heteroskedatisitas.....	34
3.4.3.4	Uji Normalitas.....	34
3.5.	Koefisien Determinasi.....	35

BAB IV PENYAJIAN DATA DAN ANALISIS PENELITIAN

4.1 Penyajian Data.....	37
4.1.1 Indeks Harga Saham Gabungan	37
4.1.2. Bunga Deposito	39
4.1.3. Nilai tukar Rupiah terhadap Dollar AS	40
4.1.4 Indeks Harga Saham Gabungan,Bunga Deposito	
dan Kurs IDR terhadap US\$	42
4.2 Analisis Pengaruh Bunga Deposito dan Nilai tukar Rupiah	
per Dollar AS terhadap Indeks Harga Saham Gabungan.....	43
4.2.1 Hasil Analisis.....	44
4.2.1.1 Statistik Deskriptif	44
4.2.1.2 Analisis Koefisien Korelasi.....	45
4.2.1.3 Analisis Regresi	47
4.2.1.4 Koefisien Determinasi	49
4.2.1.5 Uji Regresi Berganda	50
4.2.2 Uji Asumsi Klasik	51
4.2.2.1 Uji Autokorelasi	52
4.2.2.2 Uji Multikolinieritas	53

4.2.2.3 Uji Heteroskedastisitas.....	54
4.2.2.4 Uji Normalitas Data.....	55
4.3 Hasil Pengujian Hipotesis	56
4.3.1 Pengujian Hipotesis secara Simultan.....	56
4.3.2 Pengujian Hipotesis secara Parsial.....	59
BAB V SIMPULAN DAN SARAN	61
5.1 Kesiimpulan	61
5.2 Saran	62
DAFTAR PUSTAKA	63
LAMPIRAN	
Lampiran 1 Statistik BI Rate.....	64
Lampiran 2 Statistik Kurs Transaksi Bank Indonesia.....	66
Lampiran 3 Statistik IHSG.....	86
DAFTAR TABEL	
	Halaman
Tabel 4.1 Indeks Harga Saham Gabungan.....	37
Tabel 4.2 Bunga Deposito	39

Tabel 4.3	Pergerakan Nilai tukar rupai per 1 Dollar AS.....	40
Tabel 4.4	Hasil Penelitian.....	42
Tabel 4.5	Statistik Deskriptip.....	44
Tabel 4.6	<i>Correlation</i>	46
Tabel 4.7	<i>Variables Entered/Removed</i>	47
Tabel 4.8	Regresi.....	48
Tabel 4.9	Koefisien Determinasi.....	49
Tabel 4.10	Anove Test.....	50
Tabel 4.11	Hasil Analisis Nilai <i>Durbin-Watson (D-W)</i>	52
Tabel 4.12	Hasil Analisis Nilai VIF.....	53
Tabel 4.13	Model Summery Uji t secara Simultan.....	57
Tabel 4.14	Anova.....	58
Tabel 4.15	Model Summary Uji t secara Parsial.....	60

DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 4.1	Grafik Pertumbuhan Indeks Harga Saham Gabungan..... 38
Gambar 4.2	Grafik pertumbuhan Bunga Deposito..... 40
Gambar 4.3	Grafik Pergerakan Nilai tukar Rupiah terhadap Dollar AS..... 42
Gambar 4.4	Grafik Pengujian Heteroskedastisitas..... 54
Gambar 4.5	Grafik Normalitas Data..... 55
Gambar 4.6	Normal P-P Plot..... 56