

**PENGARUH SUKU BUNGA SERTIFIKAT BANK INDONESIA DAN KURS
TERHADAP INDEKS HARGA SAHAM GABUNGAN DI
BURSA EFEK INDONESIA**

SKRIPSI

Program Studi Akuntansi

Nama : JEFFRY UNGGUL MANGATAS SIMANJUNTAK

NIM : 43207120105



**FAKULTAS EKONOMI
UNIVERSITAS MERCU BUANA**

JAKARTA

2011

**PENGARUH SUKU BUNGA SERTIFIKAT BANK INDONESIA DAN KURS
TERHADAP INDEKS HARGA SAHAM GABUNGAN DI
BURSA EFEK INDONESIA**

SKRIPSI

Program Studi Akuntansi

Nama : JEFFRY UNGGUL MANGATAS SIMANJUNTAK

NIM : 43207120105



**FAKULTAS EKONOMI
UNIVERSITAS MERCU BUANA**

JAKARTA

2011

SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI

Yang bertanda tangan di bawah ini :

Nama : JEFFRY SIMANJUNTAK

NIM : 43207120105

Program Studi : Akuntansi

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, Oktober 2010



JEFFRY SIMANJUNTAK

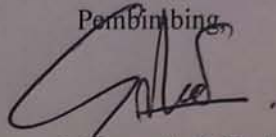
NIM : 43207120105

LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI

Nama : Jeffry Unggul Mangatas Simanjuntak
NIM : 43207120105
Program Studi : S1 Akuntansi
Judul Skripsi : Pengaruh Suku Bunga Sertifikat Bank Indonesia
dan Kurs Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan
di Bursa Efek Indonesia.
Tanggal Ujian Skripsi : 19 Agustus 2011

Disahkan oleh,

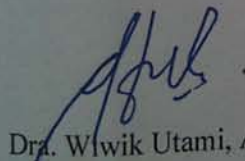
Pembimbing,



Drs. Suharmadi, M.Si., Ak.

Tanggal :

Dekan,



Dra. Wiwik Utami, Ak., M.Si.

Tanggal :

Ketua Program Studi Akuntansi,



Nurul Hidayah, S.E., Ak., M.Si.

Tanggal :

LEMBAR PENGESAHAN DEWAN PENGUJI

Skripsi Berjudul

PENGARUH SUKU BUNGA SERTIFIKAT BANK INDONESIA

DAN KURS TERHADAP INDEKS HARGA SAHAM

GABUNGAN DI BURSA EFEK INDONESIA

Dipersiapkan dan disusun oleh :

Jeffry Unggul Mangatas Simanjuntak

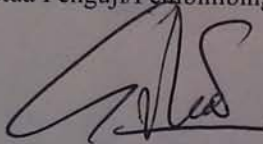
NIM : 43207120105

Telah dipertahankan di depan Dewan Penguji pada tanggal 19 Agustus 2011

Dan dinyatakan telah memenuhi syarat untuk diterima

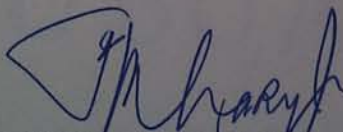
Susunan Dewan Penguji

Ketua Penguji/Pembimbing Skripsi



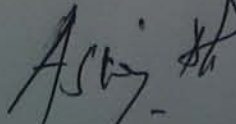
Drs. Suharmadi, M.Si., Ak.

Anggota Dewan Penguji



Hari Setiyawati, SE., Ak., M.Si.

Anggota Dewan Penguji



Drs. Marsyaf, Ak., MAk.

KATA PENGANTAR

Dengan segala kerendahan hati, penulis mengucapkan puji syukur kehadiran Tuhan yang Maha Esa atas kasih anugerahNya dan pertolonganNya penulisan skripsi ini dapat diselesaikan. Penulisan skripsi ini bertujuan untuk memenuhi salah satu syarat dalam menyelesaikan pendidikan pada Universitas Mercu Buana guna mendapat gelar Sarjana Ekonomi. Skripsi ini dengan judul **“Pengaruh Suku Bunga Sertifikat Bank Indonesia dan Kurs Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan di Bursa Efek Indonesia”**.

Penulis mempersembahkan skripsi ini kepada istri, orang tua, anakku, teman-teman, yang selalu memberikan dukungan, motivasi, dan terutama atas dukungan doa untuk penulis.

Penulis juga ingin menyampaikan terima kasih yang sebesar-besarnya pada semua pihak yaitu kepada:

1. Ibu Dr. Wiwik Utami, Ak., M.Si., Selaku Dekan Fakultas Ekonomi Universitas Mercubuana program Kelas Karyawan.
2. Ibu Nurul Hidayah, SE.,Ak.,M.Si., Selaku kaprodi Fakultas Ekonomi Akuntansi Universitas Mercubuana program Kelas Karyawan.
3. Bapak Drs. Suharmadi, M.Si.,Ak., selaku dosen pembimbing yang telah memberikan banyak bimbingan dan pengarahan kepada penulis untuk menyelesaikan skripsi ini.

4. Bapak dan Ibu dosen Fakultas Ekonomi Universitas Mercu Buana program kelas karyawan yang telah memberikan ilmu pengetahuan semasa perkuliahan.

Penulis menyadari bahwa skripsi ini belum sempurna dan masih terdapat banyak kekurangan, untuk itu penulis mengharapkan saran dan kritik yang membangun untuk penyempurnaan skripsi ini. Akhir kata penulis berharap skripsi ini dapat berguna bagi semua pihak yang memerlukan.

Jakarta, Agustus 2011

Jeffry U M Simanjuntak

DAFTAR ISI

	Halaman
Lembar Pengesahan Skripsi.....	i
Lembar Pengesahan Dewan Penguji.....	ii
Kata Pengantar.....	iii
Abstrak.....	iv
Daftar isi.....	vi
Daftar Tabel.....	viii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
A. Latar belakang	1
B. Perumusan Masalah.....	3
C. Tujuan Penelitian.....	4
BAB II LANDASAN TEORITIS.....	5
A. Sertifikat Bank Indonesia.....	5
B. Nilai Tukar (Kurs).....	7
1. Indeks Saham di Bursa Efek Indonesia.....	13
D. Resiko Saham.....	18
E. Penelitian Terdahulu.....	20
F. Kerangka Pikir dan Hipotesis.....	21
BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....	25
A. Waktu dan Tempat.....	25

B. Desain Penelitian.....	25
C. Populasi dan Sampel.....	25
D. Identifikasi Dan Defenisi Operasional Variabel.....	26
E. Metode Pengumpulan Data.....	28
F. Metode Analisis Data.....	28
G. Pengujian Hipotesis.....	33
H. Uji F.....	34
I. Uji t.....	35
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....	37
A. Statistik Deskriptif.....	37
B. Pengujian Asumsi Klasik.....	38
C. Analisi Regresi Linear Berganda.....	44
D. Uji F.....	48
E. Uji t.....	49
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	51
A. Kesimpulan.....	51
B. Saran.....	52

DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel IV.1 Data Perkembangan Suku Bunga SBI, Nilai Tukar Rupiah/US\$, IHSG di Bursa Efek Indonesia.....	38
Tabel IV.2 Hasil Uji Multikoleneartitas.....	39
Tabel IV.3 Hasil Uji Autokorelasi.....	40
Tabel IV.4 Hasil Analisis Regresi Linier Berganda.....	45
Tabel IV.5 Hasil Analisis Koefisien Determinasi.....	46
Tabel IV.6 Hasil Analisis Korelasi Parsial.....	47
Tabel IV.& Hasil Uji F.....	48