PENGARUH HARGA MINYAK DUNIA

TERHADAP

INDEKS HARGA SAHAM GABUNGAN DI BURSA EFEK

JAKARTA

SKRIPSI

Program Akuntansi

NAMA : Hanut Subekti

NIM : 03202-044

MERCU BUANA

FAKULTAS EKONOMI

UNIVERSITAS MERCU BUANA

2005

KATA PENGANTAR

Alhamdulillah atas semua anugerah dan rahmat-Nya sehingga penulis memiliki kemampuan untuk mengerjakan skripsi ini, baik secara spiritual, kesehatan jasmani, dan materil. Dan dengan seijin-Nya pula skripsi ini dapat diselesaikan, dengan ini salah satu syarat untuk menyelesaikan pendidikan S1 telah dipenuhi.

Skripsi ini disusun dengan judul " **PENGARUH HARGA MINYAK DUNIA TERHADAP INDEKS HARGA SAHAM GABUNGAN DI BURSA EFEK JAKARTA** " dengan penelitian melalui beberapa pengujian.

Tak lupa Penulis juga ingin mengucapkan rasa terima kasihnya pada pihak-pihak yang sudah turut berperan dalam pengerjaan skripsi ini. Antara lain kepada :

1. Ibu dan bapak yang selalu memberi dukungan baik secara moril maupun materil. Dan tidak lupa adik-adik dari penulis yang selalu mendukung dengan candaannya.
2. Buat semua sepedaku yang sudah mengantarkan penulis menempuh jalan hingga kekampus UMB tercinta, baik yang sudah gugur maupun yang masih tetap tangguh. Penulis akan selalu ingat masa 4 tahun bersepeda. *Love you all.*
3. Ibu Mutia yang dengan sabarnya membimbing skripsi ini hingga tuntas. Meski harus mengorbankan tenaga dan waktu istirahatnya. Tidak lupa penulis juga ingin meminta maaf jika didalam proses bimbingan penulis

membuat kesalahan baik yang disengaja maupun tidak sengaja. Penulis cukup beruntung memiliki pembimbing seperti Ibu. Semoga jasa baik ibu dapat balasan dari Allah SWT.

4. Bapak Drs. Hadri Mulya, M.Si. selaku dekan fakultas ekonomi.
5. Bapak H. Sabarudin Muslim SE. M.Si. selaku ketua jurusan akuntansi, dan penelaah seminar proposal penulis.
6. Bapak ibu dosen penguji pada sidang sripksi dan komprehensif penulis.
7. Semua dosen yang sudah membagi ilmunya kepada penulis, terutama Ibu Hari Setyowati (Aklan), Bapak Harries (Kewirausahaan), Ibu Ratna Mapanyuki (Auditing II), Bapak Yudi (Manajemen Biaya, dan AKIN). Mohon maaf kalau ada kesalahan penulisan nama, dan gelar.
8. Buat Andri Meiyanto beserta keluarga yang sudah membantu penulis menyelesaikan skripsi ini. Maaf kalau sering membuat repot, Insya Allah budi baiknya akan dibalas oleh Allah.
9. Teman-teman dari penulis yang sudah mengisi hari-hari penulis dengan bermacam-macam kenangan yang terjadi : Andri Meiyanto, Abdul Kholik, Adi Sarosa alias Oca, *best friend* "tergantung kemana arah menghadap", Aji, Ardian, Bayu Wirawan (ingat Alexandria), Cahyo, Dewi Whidiyanti, Devid, Diah&Cipee, Diah (ayu) Eka Noviyanti, Eka Mae, Eka Theresia, Elyanti, Erlina, Erma Oktarani, Fitri (jawa), Fitri (padang)&Bahana, Fatur, Fery (FTI), Hafizah (VJ), Hersa, Hesti, Lina, Lia, Nicholas, Rinda, Rusdi (chudik), Sekar Arum Mandalia, Sudirman, Usman. Dan banyak lagi yang lainnya, maaf kalau ada yang tidak disebut.

10. Teman-teman liqo dari *kabilah* Salahudin Al Ayubi : Anggie (baca; Enjie), Abin, Hari Purnomo, Nur Choirulloh, Radiwan, Syafwan, dan tak lupa Pak Budi.
11. Teman-teman ADK, terus berjuang dan tetap istiqomah dijalan dakwah!
12. Semua mahasiswa UMB dari semua angkatan yang ada.
13. Semua *Mountain Bikers* yang ada, terutama komunitas JPG, dan Azis dari Bengkel Anugerah Bike yang sudah merawat sepeda penulis.
14. Dan semua pihak yang telah membantu penulis selama ini, yang tidak bisa disebutkan satu persatu.

Sebagai seorang manusia tentu ingin membuat karya yang terbaik. Begitu pula dalam membuat skripsi ini, penulis berusaha membuat hasil yang terbaik. Namun tidak ada manusia yang sempurna, begitu pula karyanya. Kesempurnaan hanya milik Allah SWT semata. Sehingga apabila ada kekurangan harap di maklum, dan diharapkan saran dan kritiknya. Semoga skripsi ini bisa bermanfaat lebih dari sekedar tugas akhir. Dan diantara yang lebih memilih jalan pintas, masih banyak yang lebih memilih jalan, yang dibangun dengan keringat dan pikirannya sendiri.

Wassalamu'alaikum Wr.Wb.

Tangerang, 28 Agustus 2006

Penulis

LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI

Nama : HANUT SUBEKTI

NIM : 03202-044

Program Studi : AKUNTANSI

Judul Skripsi : PENGARUH HARGA MINYAK DUNIA TERHADAP IHSG DI BEJ.

Tanggal Ujian Skripsi : 22 SEPTEMBER 2006

Disahkan Oleh :

Pembimbing

(Muti'ah SE, M.Si)
Tanggal :

Dekan,

(Drs. Hadri Mulya M.si)
Tanggal :

Ketua Jurusan Akuntansi

(H. Sabarudin Muslim, SE, M.si)
Tanggal : 16/10/06

DAFTAR ISI

Halaman

HALAMAN JUDUL i

LEMBAR PENGESAHAN ii

KATA PENGANTAR iii

DAFTAR ISI iv

DAFTAR TABEL viii

DAFTAR GAMBAR ix

DAFTAR LAMPIRAN x

BAB I PENDAHULUAN

A. Latar Belakang Masalah 1

B. Perumusan Masalah 3

C. Tujuan Dan Manfaat Penelitian 3

BAB II LANDASAN TEORI

A. Minyak Dunia 5

1. Pengertian minyak dunia 5

2. Klasifikasi minyak dalam industri perminyakan 5

3. Penentuan tambang minyak yang akan diekplorasi 6

B. Harga Minyak Dunia 6

1.Ekonomi, ... 7

2.Kondisi politik global 7

3.Kondisi alam **8**

C. Pengertian Indeks Harga Saham Gabungan **8**

1. Metode perhitungan indeks harga saham gabungan **9**

a. Indeks harga saham **9**

b. IHSG (indeks tertimbang atau sederhana) **10**

c Metode Laspeyres **10**

d. Metode Paasche **11**

e. Rumus Irving Fisher **11**

f. Rumus Drobisch **11**

2. Perdagangan efek di Bursa **12**

D. Teori Portofolio **13**

1.Karakteristik umum portofolio **14**

2. Pengukuran resiko dengan CAPM **14**

E. Diversifikasi Internasional **15**

1. Pengertian **15**

2. Resiko investasi dipasar modal internasional. **15**

3. Keuntungan investasi dipasar modal internasional **16**

F. Harga Minyak Dunia Dan Indeks

Harga Saham Gabungan di BEJ **17**

BAB III METODOLOGI PENELITIAN

A. Gambaran Umum **21**

1. Sejarah minyak dunia **23**

2. Sejarah Perkembangan Pasar Modal **23**

B. Metode Penelitian **25**

C. Hipotesis **25**

D. Populasi Dan Sampel Penelitian **26**

E. Variabel Dan Pengukurannya **26**

1. Variabel Bebas (Independent) **27**

2. Variabel tak bebas (dependent) **27**

F. Definisi Operasional Variabel **28**

1. harga minyak dunia, ... **28**

2..Indeks Harga Saham Gabungan di Bursa Efek **28**

G. Metode Pengumpulan Data **28**

H. Metode Analisis Data **29**

1. Statistik Deskriptif **29**

2. Uji Normalitas Data **29**

3. Analisa Regresi Linear Sederhana **30**

a. Uji koefisien determinasi **30**

b. Uji hipotesa dengan T-Test **30**

BAB IV ANALISA HASIL DAN PEMBAHASAN

A. Analisa Harga Minyak Dunia **31**

Dan Indeks Harga Saham Gabungan. **32**

B. Seberapa Besar Harga Minyak Dunia **34**

Mempengaruhi Indeks Harga Saham Gabungan. **35**

B. Uji Normalitas Data **38**

1. *Histogram display normal curve*. **38**

2. PPlot. 39

C. Analisa Regresi Linear Sederhana 40

1. Uji koefisien determinasi 40

2. Pengujian hipotesa dengan T-Test 41

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

A. Kesimpulan 44

B. Saran 44

DAFTAR PUSTAKA

DAFTAR TABEL

halaman

Tabel IV.1 31

Tabel IV.2 32

Tabel IV.3 34

Tabel IV.4 36

Tabel IV.5 40

Tabel IV.6 41

DAFTAR GAMBAR

Halaman

Gambar IV.1 ..... **33**

Gambar IV.2 ..... **35**

Gambar IV.3 ..... **37**

Gambar IV.4 ..... **38**

Gambar IV.5 ..... **39**

DAFTAR LAMPIRAN

LAMPIRAN I : **JSX STATISTICS 2001-2005**

LAMPIRAN II : **Harga minyak**

LAMPIRAN III : **Surat riset**