

ABSTRACT

The research objective was to determine the effect on the Exchange Rates, Interest Rates, Global Stock Index movement of the Stock Price Index (IHSG) in Indonesia Stock Exchange 2011-2015 partial and simultaneous. The method used is the method of sampling purposive research, the number of samples used in this study are 7 variable : USD/IDR, Yuan/IDR, SBI Interest Rates, Index NYSE, Index SSE Composite, Index STI and Index JCI . Data used is secondary data. Data obtained through the official website of the Indonesia Stock Exchange, Indonesian Bank and Yahoo Finance. The data have been collected on the method of data analysis test is conducted prior classical assumptions before hypothesis test. Testing this hypothesis using t test F test analysis results showed that USD/IDR, Yuan/IDR, SBI Interest Rates, NYSE, SSE Composite, STI take effect to movement of the stock price index in the Indonesian stock exchange. Results of research conducted by t test (difference test) showed that USD/IDR, Yuan/IDR, SBI Interest Rates, Index NYSE, Index SSE Composite, Index STI no significant effect on the movement of Stock Jakarta Composite Index (JCI), while global stock index STI significant effect on the movement of the Stock Jakarta Composite Index (JCI).

Keywords : USD/IDR, Yuan/IDR, SBI Interest Rate, Index NYSE, Index SSE Composite, Index STI and Jakarta Composite Index (JCI).



ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh Nilai Tukar Mata Uang, Tingkat Suku Bunga dan Indeks Saham Global terhadap pergerakan IHSG di Bursa Efek Indonesia tahun 2011-2015. Metode penelitian yang digunakan yaitu metode *purposive sampling*, dengan jumlah sampel yang digunakan dalam penelitian ini adalah 7 variabel yaitu adalah Nilai Tukar Rupiah Terhadap US Dollar dan Yuan, Suku Bunga Indonesia, Indeks NYSE, Indeks SSE Composite, Indeks STI dan IHSG. Data diperoleh melalui Bursa Efek Indonesia, Bank Indonesia dan *Yahoo Finance*. Data yang telah dikumpulkan di analisis dengan metode data yang terlebih dahulu dilakukan pengujian asumsi klasik sebelum melakukan pengujian hipotesis. Pengujian hipotesis dalam penelitian ini menggunakan uji t dan uji F. Hasil analisis uji F menunjukkan bahwa adalah Nilai Tukar Rupiah Terhadap US Dollar, Nilai Tukar Rupiah Terhadap Yuan, Suku Bunga Indonesia, Indeks NYSE, Indeks SSE Composite, Indeks STI berpengaruh terhadap pergerakan indeks harga saham gabungan di bursa efek Indonesia. Hasil penelitian yang dilakukan dengan uji t (uji beda) menunjukkan Nilai Tukar Rupiah Terhadap US Dollar dan Yuan, Suku Bunga Indonesia, Indeks NYSE, Indeks SSE Composite, tidak berpengaruh signifikan terhadap pergerakan IHSG, sedangkan Indeks STI berpengaruh signifikan terhadap IHSG.

Kata kunci : US Dollar, Yuan China, BI Rate, NYSE, SSE Composite, STI dan IHSG



UNIVERSITAS
MERCU BUANA