

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisa faktor-faktor yang berpengaruh terhadap investor asing di Bursa Efek Indonesia (BEI). Faktor-faktor tersebut adalah kondisi bursa dan kurs, serta inflasi di negara tempat berinvestasi.

Variabel terkait dalam penelitian ini adalah data kurs, inflasi, likuiditas bursa, dan index saham bulanan di data Bapepam. Variabel penelitian yang digunakan diambil data bulanan dengan periode 2005-2009.

Metode analisis yang digunakan adalah metode regresi linier berganda. Hasil penelitian ini adalah kurs dan kondisi bursa, yaitu : likuiditas bursa dan index pasar memiliki pengaruh signifikan positif terhadap investasi saham di BEI. Sedangkan inflasi mempunyai pengaruh yang tidak signifikan terhadap investasi saham di BEI. Secara bersama-sama variabel index pasar, likuiditas pasar, kurs dan inflasi secara statistik mempengaruhi investasi saham di BEI.

Kata kunci : Pengaruh, Bursa dan Kurs, Inflasi, Regresi linier



UNIVERSITAS
MERCU BUANA