

PENGARUH PERUBAHAN INDEKS PASAR GLOBAL TERHADAP INDEKS HARGA SAHAM GABUNGAN (IHSG) DI BURSA EFEK INDONESIA (BEI)

Oleh :
Indra Gunawan Siregar
10090311121

INTISARI

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui seberapa besar pengaruh Indeks Pasar Global terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) baik secara parsial maupun simultan.

Metode penelitian yang digunakan dalam penelitian ini adalah deskriptif analisis, data yang digunakan adalah data kuantitatif dan teknik analisis data yang digunakan adalah analisis regresi berganda yaitu untuk mengukur berapa besar pengaruh perubahan Indeks Pasar Global terhadap IHSG, koefisien korelasi yaitu untuk mengukur keeratan hubungan antara variabel Indeks Pasar Global terhadap IHSG, koefisien determinasi yaitu untuk mengukur besarnya pengaruh variasi variabel X terhadap variabel Y serta uji t dan uji F untuk menguji signifikannya suatu hipotesis.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa perkembangan Indeks Pasar global terutama DJIA, Nikkei 225, FTSE 100 dan Straits Time selalu mengalami penguatan dan penurunan nilai. Penguatan nilai tertinggi pada DJIA 18124,71 dan penurunan nilai sebesar 15958,44. Nikkei 225, dimana penguatan terhadap nilai indeks mencapai 20563,15 dan penurunan nilai sebesar 14304,11. FTSE 100, dimana penguatan terhadap nilai indeks mencapai 7012,39 dan penurunan nilai sebesar 6408,63. Straits Time, dimana penguatan terhadap nilai indeks mencapai 3491,63 dan penurunan nilai sebesar 3049,96. Sedangkan untuk perkembangan IHSG, dimana penguatan nilai indeks sebesar 5443,52 dan penurunan nilai sebesar 4353,64.

Hasil penelitian ini menyatakan bahwa perubahan indeks pasar global, mempengaruhi indeks harga saham gabungan (IHSG) secara simultan dengan tingkat signifikansi sebesar 88,8% sedangkan 11,2% dipengaruhi faktor lain.

Kata Kunci : Pasar Modal, Indeks DJIA, Indeks FTSE 100, IHSG, Indeks Nikkei 225, Indeks Strait Time.

EFFECT OF GLOBAL MARKET INDEX STOCK PRICE INDEX (CSPI) IN INDONESIA STOCK EXCHANGE (IDX)

by :
Indra Gunawan Siregar
10090311121

ABSTRACT

This study aims to determine how much influence the Global Market Index on Stock Price Index (CSPI) either partially or simultaneously.

The method used in this research is descriptive analysis, the data used is quantitative data and data analysis technique used is multiple regression analysis is to measure how much influence changes Index Global Market on JCI, the correlation coefficient is to measure the relationship between variables Index Global market on JCI, the coefficient of determination is to measure the magnitude of the effect of variation of variable X to variable Y and the t test and a significant F test to test whether or not a hypothesis.

The results showed that the development of the global market, especially the DJIA index, Nikkei 225, FTSE 100 and the Straits Time always has strengthened and impairment. Strengthening of the highest in the DJIA 18124.71 and impairment amounted to 15958.44. Nikkei 225, where the strengthening of the value of the index reached 20563.15 and impairment amounted to 14304.11. FTSE 100, where the strengthening of the value of the index reached 7012.39 and impairment amounted to 6408.63. Straits Time, where the strengthening of the value of the index reached 3491.63 and impairment amounted to 3049.96. As for the development of JCI, where the strengthening of the value of the index amounted to 5443.52 and impairment amounted to 4353.64.

The results of this study suggests that changes in global market indices, affect the stock price index (CSPI) simultaneously with a significant level of 88.8% and 11.2% in the influence of other factors.

Keywords : Capital Markets, the DJIA index, the FTSE 100 index, JCI, Nikkei 225, Straits Time Index.