

ABSTRAK

RISMAWATI, NPM : 71170313062. Judul : Analisis Pengaruh Nilai Tukar Rupiah/US Dollars Dan Tingkat Suku Bunga SBI Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia, Dibimbing Oleh : Dr. Safrida.,S.E.,M.Si sebagai Pembimbing I, dan Lusi Elviani Rangkuti S.E.,M.Si sebagai Pembimbing II. Skripsi : 2021

Rumusan masalah dalam penelitian ini adalah sejauh mana Nilai Tukar Rupiah/US Dollars dan Tingkat Suku Bunga SBI secara parsial maupun simultan berpengaruh terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh Nilai Tukar Rupiah/US Dollars dan Tingkat Suku Bunga SBI baik secara parsial maupun secara simultan mempunyai pengaruh yang signifikan terhadap IHSG di Bursa Efek Indonesia. Populasi dalam penelitian ini adalah Nilai Tukar Rupiah/US Dollars, Tingkat Suku Bunga SBI dan IHSG tahun 2015-2019. Sampel yang digunakan dalam penelitian ini adalah menggunakan sampling jenuh atau sampel sensus, yaitu teknik penentuan sampel dimana semua anggota populasi digunakan sebagai sampel. Jenis penelitian yang digunakan adalah penelitian kuantitatif. Pengujian yang dilakukan adalah analisis regresi linear berganda dengan terlebih dahulu melakukan uji asumsi klasik yang meliputi uji normalitas, multikolinearitas, autokorelasi, dan heteroskedastisitas. Penelitian ini menggunakan *software* SPSS versi 25. Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwa Nilai Tukar Rupiah/US Dollars dan Tingkat Suku Bunga SBI secara simultan berpengaruh terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) dilihat dari hasil uji regresi yaitu nilai uji F-hitung yang lebih besar dari nilai F-tabel. Secara parsial variabel Tingkat Suku Bunga SBI tidak mempunyai pengaruh yang signifikan terhadap Indeks Harga Saham Gabungan di Bursa Efek Indonesia periode 2015-2019. Hal ini ditunjukkan dari besarnya nilai t-hitung kecil dari t-tabel ($0,089 < 1,960$) sementara variabel Nilai Tukar Rupiah/US Dollars secara parsial mempunyai pengaruh positif yang signifikan terhadap Indeks Harga Saham Gabungan Di Bursa Efek Indonesia periode 2015-2019. Hal ini ditunjukkan dari besarnya nilai t-hitung lebih besar dari t-tabel ($3,140 > 1,960$).

Kata Kunci : Nilai Tukar Rupiah/US Dollars, Tingkat Suku Bunga SBI, IHSG

ABSTRACT

RISMAWATI, NPM: 71170313062. Title: Analysis of the Effect of Rupiah Exchange Rate / US Dollars and SBI Interest Rates on Composite Stock Price Index (IHSG) Listed on the Indonesia Stock Exchange, Guided by: Dr. Safrida., S.E., M.Si as Advisor I, and Lusi Elviani Rangkuti S.E., M.Si as Advisor II. Thesis: 2021

The formulation of the problem in this study is the extent to which the Rupiah Exchange Rate / US Dollars and SBI Interest Rates partially or simultaneously affect the Composite Stock Price Index (IHSG) listed on the Indonesia Stock Exchange. This study aims to determine the effect of the Rupiah Exchange Rate / US Dollars and the SBI Interest Rate, either partially or simultaneously, which have a significant effect on the JCI on the Indonesia Stock Exchange. The population in this study were the Rupiah Exchange Rate / US Dollars, SBI Interest Rates and IHSG 2015-2019. The sample used in this study is to use saturated sampling or census sampling, which is a sampling technique in which all members of the population are used as samples. This type of research is quantitative research. The test performed is multiple linear regression analysis by first performing a classic assumption test which includes normality, multicollinearity, autocorrelation, and heteroscedasticity tests. This study uses SPSS version 25 software. The results of this study indicate that the Rupiah / US Dollars Exchange Rate and the SBI Interest Rate simultaneously affect the Composite Stock Price Index (IHSG) as seen from the results of the regression test, namely the F-count test value which is greater than the F-table value. The partial level of the SBI Interest Rate variable does not have a significant effect on the Composite Stock Price Index on the Indonesia Stock Exchange for the period 2015-2019. This is indicated by the small t-count value of the t-table ($0.089 < 1.960$), while the Rupiah / US Dollars Exchange Rate variable partially has a significant positive effect on the Composite Stock Price Index on the Indonesia Stock Exchange for the period 2015-2019. This is indicated by the magnitude of the t-count value is greater than the t-table ($3,140 > 1,960$).

Keywords : Rupiah Exchange Rate / US Dollars, SBI Interest Rate, IHSG