

ABSTRAK

Nama : Faizal Rhamdani
Program Studi : Ekonomi Pembangunan
Judul : Analisis Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Pergerakan Indeks Harga Saham Gabungan di Bursa Efek Indonesia

Skripsi ini berisikan kajian mengenai faktor-faktor yang mempengaruhi indeks harga saham gabungan di bursa efek Indonesia pada tahun 2012 triwulan I sampai dengan 2016 triwulan IV. Metode analisis yang digunakan adalah analisis regresi linier berganda.

Variabel yang digunakan dalam tulisan ini adalah indeks harga saham gabungan, tingkat suku bunga deposito, nilai tukar (kurs) rupiah/dollar Amerika Serikat, inflasi dan pertumbuhan ekonomi. Data diolah dengan menggunakan model *Ordinary Last Square* (OLS) dengan alat (*software*) pengolahan Eviews 9. Data yang digunakan adalah *time series* dari publikasi Bank Indonesia dan Bursa Efek Indonesia.

Hasil analisis menunjukkan bahwa secara parsial variabel tingkat suku bunga deposito (iDEP) memiliki hubungan negatif dan berpengaruh terhadap indeks harga saham gabungan (IHSG), variabel nilai tukar (KURS) berpengaruh secara negatif terhadap indeks harga saham gabungan (IHSG), variabel inflasi (INF) berpengaruh secara negatif tetapi tidak berpengaruh terhadap indeks harga saham gabungan (IHSG), dan variabel pertumbuhan ekonomi berpengaruh negatif terhadap indeks harga saham gabungan (IHSG) di Indonesia selama periode penelitian. Sementara secara simultan variabel tingkat suku bunga deposito (iDEP), nilai tukar (KURS), inflasi (INF) dan pertumbuhan ekonomi (LPE) berpengaruh terhadap indeks harga saham gabungan (IHSG dengan proporsi pengaruh sebesar 76,39% sedangkan sisanya 23,61% dipengaruhi oleh faktor lain di luar penelitian.

Kata kunci : *Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG), Tingkat Suku Bunga Deposito (iDEP), Nilai Tukar (KURS), Inflasi (INF) dan Pertumbuhan Ekonomi (LPE).*