

ABSTRAK

ANALISIS DAMPAK KENAIKAN INFLASI TERHADAP HARGA DAN VOLUME PERDAGANGAN SAHAM PER SEKTOR SAHAM DI BURSA EFEK INDONESIA (BEI)

**Vaschalis David Suswanto
Universitas Sanata Dharma
Yogyakarta 2009**

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui dampak kenaikan inflasi terhadap harga dan volume perdagangan saham per sektor saham di Bursa Efek Indonesia (BEI).

Penelitian ini dilakukan selama bulan April sampai Agustus 2008 di Pojok Bursa Efek Fakultas Ekonomi Universitas Sanata Dharma, Yogyakarta. Pengumpulan data dilakukan dengan teknik observasi. Populasi yang digunakan dalam penelitian ini adalah keseluruhan data tentang harga dan volume perdagangan saham yang terdaftar di BEI bulan Januari 2003-Desember 2007. Sampel dalam penelitian ini adalah sebanyak 121 saham, dan pengambilannya menggunakan teknik Proportional Random Sampling. Teknik analisis data yang digunakan adalah analisis regresi linear sederhana.

Hasil penelitian ini menunjukkan hasil bahwa inflasi tidak berpengaruh negatif secara signifikan terhadap harga saham secara umum. Inflasi berpengaruh secara signifikan terhadap harga saham di sektor Industri barang-barang konsumsi, Properti dan Real Estate, dan Infrastruktur, Utilitas dan Transportasi. Inflasi tidak berpengaruh positif secara signifikan terhadap volume perdagangan. Inflasi berpengaruh secara signifikan terhadap volume perdagangan saham di sektor Industri dasar dan Kimia, Keuangan, dan Perdagangan, Jasa dan Investasi.

ABSTRACT

THE INFLUENCE OF INFLATION ON PRICE AND TRADE VOLUME OF SHARES IN INDONESIAN STOCK EXCHANGE

**Vaschalis David Suswanto
University of Sanata Dharma
Yogyakarta 2009.**

This research aims to know the influence of inflation on volume and price of shares listed in Indonesian Stock Exchange.

This research was conducted in April until August 2008 using data base of Stock Exchange of Economics Faculty University of Sanata Dharma, Yogyakarta. Data were collected using observation. The population is the entire data on volume and price of shares in listed Indonesian Stock Exchange from January 2003 to Desember 2007. Samples of this research were 121 shares, which were taken using Proportional Random Sampling. Data analysis techniques used was Simple Linear Regression Analysis.

Results of this research showed that inflation did not influence significantly the share price in general. Inflation influenced share prices in the sectors of Consumption Goods Industry, Property and Real Estate, and Infrastructure and Utility and Transportation sectors. Inflation generally did not influence on traded volumes of shares. Inflation influenced the traded volume of shares only in Chemical and Elementary Industry, Finance, Commerce, and Service and Investment sectors.