

ABSTRAK

PENGARUH TINGKAT SUKU BUNGA DEPOSITO, KURS VALAS, DAN
INFLASI TERHADAP INDEKS HARGA SAHAM GABUNGAN
PERIODE TAHUN 2006-2010

Studi Empiris Di Bursa Efek Indonesia

Wuny Stiawati. S
NIM: 072114102
Universitas Sanata Dharma
Yogyakarta
2011

Tujuan penelitian ini adalah untuk mengetahui pengaruh antara tingkat suku bunga deposito, kurs valas, dan inflasi secara simultan dan parsial terhadap indeks harga saham gabungan di BEI periode tahun 2006-2010.

Jenis penelitian adalah studi empiris. Data diperoleh melalui pojok BEI yang ada di Yogyakarta dengan cara dokumentasi. Teknik analisis data yang digunakan adalah dengan model analisis regresi linier berganda.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa berdasarkan hasil analisis data dan pembahasan yang telah dilakukan ada pengaruh secara simultan antara tingkat suku bunga deposito, kurs valas, dan inflasi terhadap indeks harga saham gabungan di BEI periode tahun 2006-2010, sedangkan secara parsial suku bunga deposito dan kurs valas berpengaruh negatif dan faktor inflasi tidak berpengaruh terhadap indeks harga saham gabungan di BEI periode tahun 2006-2010.

ABSTRACT

THE INFLUENCE OF DEPOSIT RATES,
FOREIGN EXCHANGE RATE, AND INFLATION
TOWARD COMPOSITE STOCK PRICE INDEX PERIOD 2006-2010

An Empirical Study in Indonesia Stock Exchange

Wuny Stiawati. S
Student Number: 072114102
Sanata Dharma University
Yogyakarta
2011

This research aimed to find the influence of deposit rates, foreign exchange rate, and inflation simultaneously and partially toward composite stock price index in Indonesia Stock Exchange period 2006-2010.

The type of research used in this study was empirical study. The data were gathered from Indonesia Stock Exchange corner in Yogyakarta by documentation. The researcher used multiple linear regression analysis model as the data analysis technique.

Based on the data analysis and the discussion, the result of this research showed that simultaneously there was influence of deposit rates, foreign exchange rate, and inflation toward composite stock price index in Indonesia Stock Exchange period tahun 2006-2010, while partially deposit rates and foreign exchange rate showed negative influence and the inflation factor did not influence the composite stock price index in Indonesia Stock Exchange period 2006-2010.