

ABSTRAK
PENGUJIAN EFISIENSI BENTUK LEMAH
PASAR MODAL INDONESIA

Thomson Peranginangin
Universitas Sanata Dharma
Yogyakarta
2002

Tujuan penelitian ini adalah untuk mengetahui apakah Pasar Modal Indonesia (PT. Bursa Efek Jakarta) sudah efisien dalam bentuk lemah. Penelitian dilakukan di PT. Bursa Efek Jakarta. Pengambilan Data dilakukan dengan cara pencatatan langsung terhadap data sekunder, yaitu data yang diperoleh dalam bentuk yang sudah jadi dalam bentuk publikasi .

Sampel yang digunakan adalah 60 (enam puluh) perusahaan dari sekitar 280 (dua ratus delapan puluh) perusahaan yang terdaftar di PT. Bursa Efek Jakarta. Teknik Analisa data yang digunakan untuk menjawab masalah yang ada adalah teknik korelasi dan koefisien korelasi product moment.

Berdasarkan analisa data yang ada dapat dikatakan bahwa tidak ada pengaruh (hubungan) informasi harga saham pada minggu sebelumnya dengan minggu saat ini, maka efisiensi Pasar Modal Indonesia (PT. Bursa Efek Jakarta) dalam bentuk lemah terpenuhi.

ABSTRACT
AN EXAMINATION ON THE WEAK FORM EFFICIENCY OF
INDONESIAN CAPITAL MARKET

Thomson Peranginangin
Sanata Dharma University
Yogyakarta
2002

The purpose of this research was to know if Indonesia Capital Market (Jakarta Stock Exchange) had been efficient in the weak form. This research was done in Jakarta Stock Exchange. The data was obtained from the publication released by the Jakarta Stock Exchange.

The sample used was 60 (sixty) companies from approximately 280 (two hundreds and eighty) registered companies in Jakarta Stock Exchange. The data analyzing technique used was the correlation technique and Product Moment Correlation Coefficient.

According to the data analysis, the research concluded that releasing information of share price one week in advance had no influence on the one within this coming week. Therefore, it could be concluded that the efficiency of Indonesian Share Market (Jakarta Stock Exchange) in the weak form was proceeded.