

ABSTRAK

ANALISIS PENGARUH INFLASI, SUKU BUNGA, HARGA MINYAK MENTAH, DAN HARGA BATU BARA TERHADAP INDEKS HARGA SAHAM SEKTOR PERTAMBANGAN DI INDONESIA PERIODE 2016-2022

Hizkia Alva Tesselonika Sombolinggi

NIM: 202314036

Universitas Sanata Dharma

Yogyakarta

2024

Perusahaan sektor pertambangan merupakan salah satu perusahaan yang berpengaruh besar bagi perekonomian Indonesia. Indeks harga saham sektor pertambangan yang tercatat di Bursa Efek Indonesia mengidentifikasi keadaan di pasar modal dan berpengaruh kepada pertumbuhan ekonomi maupun komoditas tambang di dalamnya, sehingga ada beberapa faktor yang dapat mempengaruhi indeks harga saham pada sektor pertambangan seperti variabel makro ekonomi ataupun harga komoditas tambang.

Penelitian ini dilakukan untuk menguji secara empiris Pengaruh dari Inflasi, Suku Bunga, Harga Minyak Mentah, dan Harga Batu Bara Terhadap Indeks Harga Saham Sektor Pertambangan Periode 2016-2022. Variabel independen yang digunakan di dalam penelitian ini yaitu Inflasi (X1), Suku Bunga (X2), Harga Minyak Mentah (X3), dan Harga Batu Bara (X4), sedangkan variabel dependen yaitu Indeks Harga Saham Sektor Pertambangan (Y). Penelitian ini merupakan penelitian kuantitatif dengan pengumpulan data melalui website resmi yaitu IDX, BI, BPS, Yahoo Finance. Jenis penelitian ini adalah kuantitatif dengan metode analisis data yang digunakan berupa analisis regresi linear berganda, uji asumsi klasik, dan uji hipotesis menggunakan alat analisis SPSS versi 25.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa variabel independen Inflasi, Suku Bunga, Harga Minyak Mentah dan Harga Batu Bara secara simultan berpengaruh terhadap Indeks Harga Saham Pada Sektor Pertambangan. Hasil Uji t menunjukkan bahwa variabel Inflasi, Suku Bunga, dan Harga Batu Bara secara parsial berpengaruh signifikan terhadap Indeks Harga Saham Pada Sektor Pertambangan, sedangkan variabel Harga Minyak Mentah tidak berpengaruh signifikan terhadap Indeks Harga Saham Pada Sektor Pertambangan

Kata kunci : Indeks harga saham, inflasi, suku bunga, harga minyak mentah, dan harga batu bara

ABSTRACT

ANALYSIS OF THE EFFECT OF INFLATION, INTEREST RATES, CRUDE OIL PRICES AND COAL PRICES TO THE STOCK PRICE INDEX MINING SECTOR IN INDONESIA PERIOD 2016-2022

Hizkia Alva Tesselonika Sombolinggi

NIM: 202314036

Universitas Sanata Dharma

Yogyakarta

Mining sector companies are one of the companies that have a major influence on the Indonesian economy. The stock price index in the mining sector listed on the Indonesia Stock Exchange identifies what happens in the capital market and affects economic growth and mining commodities in it, so there are several factors that can affect the stock price index in the mining sector such as macroeconomics or mining commodities.

This study was conducted to determine the Effect of Inflation, Interest Rates, Crude Oil Prices, and Coal Prices on the Stock Price Index in the Mining Sector for the 2016-2022 Period. The independent variables used in this study are Inflation (X1), Interest Rates (X2), Crude Oil Prices (X3), and Coal Prices (X4), while the dependent variable is the Stock Price Index in the Mining Sector (Y). This study uses quantitative research with data collection through the official website, namely IDX, BI, BPS, Yahoo Finance. The type of research used in this study is quantitative with the data analysis method used is multiple linear regression analysis, classical assumption test, and hypothesis test using the SPSS version 25 analysis tool.

The results of this study indicate that the independent variables of Inflation, Interest Rates, Crude Oil Prices and Coal Prices simultaneously affect the Stock Price Index in the Mining Sector. The t-test results show that the variables of Inflation, Interest Rates, and Coal Prices partially have a significant effect on the Stock Price Index in the Mining Sector, while the Crude Oil Price variable does not have a significant effect on the Stock Price Index in the Mining Sector.

Keywords: *Stock price index, inflation, interest rates, crude oil prices, coal price*