

ABSTRAK

ANALISIS PENGARUH PELEMAHAN NILAI TUKAR RUPIAH TERHADAP HARGA SAHAM SEKTORAL PADA INDEKS LQ45 DI BURSA EFEK INDONESIA

(Sebelum dan Saat Pelemahan Nilai Tukar Rupiah terhadap Dolar Amerika Serikat pada Kelompok LQ45 Periode Agustus 2015 – Oktober 2015)

Ni Nyoman Ayu Purnama Dewi

NIM : 122214058

Universitas Sanata Dharma

Yogyakarta

2016

Tujuan penelitian ini untuk mengetahui perbedaan harga saham dan daya tahan perusahaan pada berbagai sektor perusahaan yang diteliti yaitu sektor konsumsi, sektor pertanian/perkebunan, sektor aneka industri dan sektor perbankan di indeks LQ45 pada waktu sebelum dan saat terjadinya pelemahan nilai tukar rupiah terhadap dolar Amerika Serikat. Jenis penelitian yang dilakukan adalah berupa penelitian komparatif dengan menggunakan data sekunder. Data diperoleh dari hasil publikasi Bursa Efek Indonesia dan Bank Indonesia.

Penelitian ini menggunakan teknik observasi dokumen yaitu pencatatan langsung dari data sekunder. Metode pengumpulan data yaitu mencatat, mengumpulkan dan mengolah data-data tertulis yang berhubungan dengan masalah penelitian mengenai harga saham dan nilai tukar rupiah.

Berdasarkan hasil analisis, pengujian hipotesis pertama menggunakan uji T (*Paired sample T-test*) menunjukkan bahwa ada perbedaan harga saham pada berbagai sektor perusahaan di Indeks LQ45 pada waktu sebelum dan saat terjadinya pelemahan nilai tukar rupiah terhadap dolar Amerika Serikat. Pada masalah kedua menggunakan analisis *koefisien varians* dan analisis *trend* menunjukkan bahwa ada perbedaan daya tahan perusahaan dilihat dari harga saham di antara berbagai sektor perusahaan pada indeks LQ45 berdasarkan sensitivitasnya atas pelemahan nilai tukar rupiah terhadap dolar Amerika Serikat.

ABSTRACT

**ANALYSIS OF THE INFLUENCE OF DEPRECIATION RUPIAH
EXCHANGE RATE ON THE STOCK PRICE SECTORS OF LQ45 INDEX
IN INDONESIA STOCK EXCHANGE**

**(Before and at the Moment of the Depreciation of Rupiah Exchange Rate
against the United States Dollar in LQ45 Group period of August 2015 -
October 2015)**

Ni Nyoman Ayu Purnama Dewi

NIM: 122214058

Sanata Dharma University

Yogyakarta

2016

The aim of this study is to find out the differences of stock price and resistance company on the various of company sectors namely consumption sector, agriculture / horticulture sector, various industry sector and banking sector of LQ45 index at before and at the moment of depreciation rupiah exchange rate against the United States dollars. This study is an comparative study using secondary data. Data was obtained from the publication of the Indonesia Stock Exchange and Bank Indonesia.

This study used document observation techniques that is recording directly from secondary data. Method of data collection used were recording, collecting and processing the written data related to the problem of research on the stock price and rupiah exchange rate.

Based on the analysis after performing testing for the first hypothesis using T test (Paired sample t-test), the study found that there was the difference of stock price on various companies sector in the LQ45 Index before and at the moment of the depreciation of rupiah exchange rate against the United States dollar. The study also found that there were the differences of company resistance seen from the difference price between the various of company sector in the LQ45 index based on sensitivity differences of depreciation rupiah exchange rate against the United States dollar.