

# **ANALISIS PENGARUH FLUKTUASI KURS VALUTA ASING (US DOLLAR, EURO, POUNDSTERLING, YEN DAN SINGAPORE DOLLAR) TERHADAP INDEKS HARGA SAHAM GABUNGAN DI BURSA EFEK JAKARTA**

**YUSUSP DARMA SAPUTRA, JULIUS NURSYAMSI, SE, MM**

Penulisan Ilmiah, Fakultas Ekonomi, 2007

Universitas Gunadarma

<http://www.gunadarma.ac.id>

kata kunci : saham

Abstraksi :

Dalam penulisan ilmiah ini Penulis bertujuan untuk mengetahui bagaimana hubungan dan pengaruh dari fluktuasi kurs valuta asing terhadap IHSG yang juga berfluktuasi. Penulis menggunakan data IHSG dan nilai jual kurs US Dollar dan Euro terhadap Rupiah mulai tanggal 26 Maret 2007 sampai 30 Maret 2007. Metode yang digunakan adalah Metode Regresi Linier Berganda dengan menggunakan SPSS. Berdasarkan perhitungan dengan metode Regresi Linier Berganda dapat diketahui kurs jual model 1  $Y = 2.174,517 + 0,296 X_2 + 4,926 X_4 + 0,592 X_5$ , dengan analisis Korelasi didapat  $r = 0,628$  dan analisis Koefisien Determinasi didapat  $r^2 = 0,394$  atau 39,4 %. Untuk model 2  $Y = 2.204,650 + 0,293 X_2 + 0,655 X_5$  dengan analisis Korelasi didapat  $r = 0,611$  dan analisis Koefisien Determinasi didapat  $r^2 = 0,374$  atau 37,4%. Untuk model 3  $Y = 1.750,307 + 0,005 X_2$  dengan analisis Korelasi didapat  $r = 0,151$  dan analisis Koefisien Determinasi didapat  $r^2 = 0,023$  atau 2,3%. Untuk Kurs Beli  $Y = 3.780,394 + 1,698 X_1 + 1,594 X_2 + 14,505 X_4 + 0,118 X_5$  dengan analisis Korelasi didapat  $r = 1$  dan analisis Koefisien Determinasi didapat  $r^2 = 1$  atau 100%. Untuk Kurs Jual  $Y = 24.701,739 + 1,976 X_1 + 0,463 X_2 + 98,121 X_4 + 1,136 X_5$  dengan analisis Korelasi didapat  $r = 1$  dan analisis Koefisien Determinasi  $r^2 = 1$  atau 100%.