

ANALISIS PENGARUH INDEKS HARGA SAHAM BANK MILIK NEGARA TERHADAP INDEKS HARGA SAHAM GABUNGAN

I Gusti Bagus Wira Aryawan, Reni Anggraini, SE., MMSI

Penulisan Ilmiah, Fakultas Ekonomi, 2008

Universitas Gunadarma

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

kata kunci : saham, regresi linier berganda,

Abstraksi :

Sebuah negara dapat diklasifikasikan sebagai negara yang maju, berkembang ataupun terbelakang berdasarkan tinjauan kondisi perekonomian yang dialami oleh negara tersebut. Salah satu instrumen perekonomian termudah yang dapat dijadikan sebagai indikator perekonomian negara adalah pasar modal, sebab pasar modal adalah sistem yang terorganisasi yang di dalamnya terdapat kegiatan yang berkaitan dengan penawaran dan permintaan efek, Perusahaan Go Public yang berkaitan dengan efek yang diterbitkannya, serta lembaga dan profesi penunjang pasar modal yang berkaitan dengan efek. Untuk dapat mengetahui kondisi pasar modal kita dapat mengikuti perkembangan mengenai IHSG atau Indeks Harga Saham Gabungan. Sebab IHSG merupakan total perhitungan rata-rata dari seluruh transaksi perdagangan efek yang terjadi di bursa efek pada suatu hari tertentu. Judul penulisan ilmiah ini adalah Analisis Pengaruh Indeks Harga Saham Bank Milik Negara terhadap Indeks Harga Saham Gabungan. Fokus pembahasan dalam penulisan ilmiah ini adalah faktor-faktor yang mempengaruhi IHSG atau Indeks Harga Saham Gabungan dengan mengambil contoh kasus dari pengaruh Indeks Harga Saham Bank Milik Negara yaitu Bank Mandiri (BMRI), Bank BNI (BBNI), dan Bank BRI (BBRI) terhadap Indeks Harga Saham Gabungan berdasarkan periode tahun 2002 sampai dengan 2007. Model yang digunakan dalam penelitian yaitu model deskriptif dengan jenis data kuantitatif. Instrumen penelitian adalah studi kepustakaan dan studi internet. Objek dalam penulisan ilmiah ini adalah PT Bursa Efek Indonesia. PT Bursa Efek Indonesia terletak di Jalan Jendral Sudirman Kavling 52 53 , Jakarta 12190 selaku pihak yang menyelenggarakan dan menyediakan sistem dan sarana untuk mempertemukan penawaran jual dan beli efek. Analisis data dengan menggunakan uji normalitas, uji asumsi klasik heteroskedastisitas, uji regresi linier berganda, dan uji korelasi.