

## ABSTRAK

**IQBAL AWALUDIN.** 2018. Pengaruh Inflasi dan Nilai Tukar / Kurs Rupiah terhadap Indeks Harga Saham Gabungan IHSG di Bursa Efek Indonesia Periode 2012-2017.

Latar belakang terbentuknya judul skripsi ini salah satunya adalah pengambilan keputusan yang akan di lakukan oleh investor, Penelitian ini memiliki tujuan untuk menganalisis seberapa besar pengaruh Inflasi dan Nilai Tukar / Kurs Rupiah terhadap Indeks Harga Saham Gabungan IHSG di Bursa Efek Indonesia secara parsial maupun secara simultan,

Metode yang digunakan adalah metode deskriptif dan verifikatif, penelitian yang di gunakan adalah Kuantitatif, teknik pengambilan data menggunakan data sekunder, selanjutnya teknik Uji Asumsi klasik dengan menggunakan Uji Normalitas, Uji Autokorelasi, Uji Multikolinieritas, Uji Heteroskedastisitas, data yang digunakan data time series sementara uji hipotesis menggunakan uji T (parsial) serta uji f (simultan) dengan tingkat signifikansi 5%. dengan bantuan *software SPSS 20 for windows*.

Hasil penelitian uji parsial menunjukkan nilai signifikansi Inflasi sebesar  $0,000 < 0,05$ , dengan nilai t hitung  $-4.313$  lebih kecil dari t tabel  $1.997$ , dengan demikian maka  $H_0$  ditolak yang berarti tidak terdapat pengaruh positif dan signifikan dari inflasi terhadap IHSG pada Bursa efek Indonesia Periode 2012-2017, nilai t hitung  $-4.313$  menunjukkan arah negatif yang artinya inflasi berpengaruh negatif terhadap IHSG. Nilai tersebut menunjukkan jika nilai Inflasi Menaik maka IHSG yang dicapai oleh Bursa Efek Indonesia akan menurun, begitu sebaliknya.

Hasil uji parsial menunjukkan nilai signifikansi Nilai Tukar / Kurs Rupiah sebesar  $0,000 < 0,05$ , t hitung untuk variabel Nilai Tukar / Kurs Rupiah sebesar  $10.424$  lebih besar dari nilai t tabel  $1.997$ , maka dapat disimpulkan  $H_0$  ditolak dan  $H_a$  diterima, yang artinya terdapat pengaruh positif dan signifikan antara Nilai Tukar / Kurs Rupiah terhadap Indeks Harga Saham Gabungan IHSG di Bursa Efek Indonesia periode 2012-2017. Nilai t hitung  $10.424$  menunjukkan arah positif, artinya jika nilai/harga naik maka IHSG juga akan naik begitupun sebaliknya.

Secara simultan terdapat pengaruh yang signifikan antara Inflasi dan Nilai Tukar / Kurs Rupiah terhadap Indeks Harga Saham Gabungan IHSG. serta diketahui nilai  $R^2$  (R Square) sebesar  $0.620$  atau sebesar  $62.0\%$ . Maka dapat disimpulkan bahwa Inflasi dan Nilai Tukar / Kurs Rupiah secara simultan berpengaruh terhadap Indeks Harga Saham Gabungan sebesar  $62.0\%$  dan sisanya  $38.0\%$  dipengaruhi oleh faktor lain.

**Kata Kunci :Inflasi, Nilai Tukar/ Kurs Rupiah dan Indeks Harga Saham Gabungan**