



No. Alumni Universitas :	Nico Fernando	No. Alumni Fakultas :
a) Tempat/Tanggal Lahir : Padang/24 Mei 1990 b) Nama Orang Tua : H. Amiruddin, SH, MH dan Hj. Eny Nofrida c) Fakultas : Ekonomi d) Jurusan : Manajemen e) No. BP : 0810522100 f) Tanggal Lulus : 20 Juli 2012 g) Predikat Lulus : Sangat Memuaskan h) IPK : 3,13 i) Lama Studi : 3 tahun 11 bulan j) Alamat Orang Tua : Komplek Singgalang Blok A2/No. 29		

Pengaruh Return Indeks Bursa Global Terhadap Return Indeks Harga Saham Gabungan Pada Bursa Efek Indonesia Periode Tahun 2009-2011.

Skripsi Oleh : Nico Fernando
Pembimbing : Prof. Dr. Tafdil Husni, SE, MBA

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis dan mengetahui perkembangan indeks harga saham bursa global dalam hubungannya dengan besarnya return indeks harga saham gabungan (IHSG) di Bursa Efek Indonesia (BEI) serta untuk mengetahui besarnya pengaruh return indeks harga saham bursa global secara simultan maupun parsial yang diwakili oleh enam bursa saham global terhadap IHSG pada BEI. Adapun ke enam bursa saham global tersebut adalah indeks saham DJIA (Dow Jones Industrial Average) yang mewakili bursa saham Amerika Serikat, N225 (Nikkei) yang mewakili bursa saham Jepang, FTSE100 (Financial Times Stock Exchange) yang mewakili bursa saham Inggris, KOSPI200 (Korea Composite Stock Price Index) yang mewakili bursa saham Korea Selatan, HSI (Hang Seng Index) yang mewakili bursa saham Hong Kong, dan STI (Strait Times Index) yang mewakili bursa saham Singapura. Pengumpulan data dilakukan dengan pendekatan sampel sederhana yang dipakai dengan mengumpulkan data selama 36 bulan dari tahun 2009 sampai tahun 2011. Pengolahan data penelitian menggunakan uji asumsi klasik, analisis regresi berganda serta uji korelasi pearson menggunakan program SPSS 16.0. Hasil penelitian menyimpulkan bahwa return keenam indeks bursa saham global secara bersama-sama berpengaruh secara signifikan tetapi secara individual hanya return indeks bursa KOSPI yang mempengaruhi return IHSG pada BEI dan hasil uji korelasi pearson menunjukkan bahwa return DJIA, NIKKEI, FTSE, KOSPI, HSI, dan STI memiliki korelasi yang kuat dengan return IHSG, namun return STI memiliki korelasi yang paling kuat di antara bursa saham lainnya. Hasil penelitian memberikan implikasi bahwa investor perlu memantau kondisi bursa saham di Singapura karena return aktual bulanan STI memiliki korelasi yang paling kuat dan signifikan terhadap IHSG di Bursa Efek Indonesia karena pergerakan saham STI mempengaruhi fluktuasi IHSG di Bursa Efek Indonesia, sehingga juga dapat memprediksi return aktual yang akan diperoleh. Selain itu keterkaitan bursa saham antara suatu negara dengan negara lain juga perlu diperhatikan karena adanya pengaruh secara langsung maupun tidak langsung terhadap bursa saham negara tersebut.

Kata Kunci : DJIA, NIKKEI, FTSE, KOSPI, Hang Seng, STI, dan IHSG BEI

Skripsi ini telah dipertahankan di depan sidang penguji dan dinyatakan lulus pada **20 Juli 2012**.

Abstrak ini telah disetujui oleh pembimbing dan penguji :

Tanda Tangan	1.	2.	3.
Nama Terang	<i>Fajri Adrianto, SE, M.Bus</i>	<i>Dr. Vera Pujani, SE, MM.Tech</i>	<i>Sari Surya, SE, MM</i>

Mengetahui :
Ketua Jurusan Manajemen

Dr. Harif Amali Rivai, SE, M.Si
NIP. 197102211997011001

_____ **Tanda Tangan**

Alumnus telah mendaftar ke Fakultas/Universitas dan mendapat nomor alumnus :

		Petugas Fakultas/Universitas	
No. Alumni Fakultas	Nama	Tanda Tangan	
No. Alumni Universitas	Nama	Tanda Tangan	