

ABSTRAK

ADAM NURKHOLIK. *Pengaruh Suku Bunga Sertifikat Bank Indonesia (SBI) dan Nilai Tukar Rupiah Terhadap Indeks Harga Saham LQ45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2005 - 2012*. Fakultas Ekonomi Universitas Negeri Jakarta. 2013.

Tujuan penelitian ini adalah menguji pengaruh suku bunga SBI dan nilai tukar Rupiah terhadap indeks harga saham LQ45 di BEI pada tahun 2005-2012 secara parsial maupun simultan. Metode penelitian menggunakan metode *ekspos facto*. Teknik analisis data yang digunakan dalam penelitian ini adalah analisis regresi berganda. Hasil regresi penelitian menunjukkan suku bunga SBI berpengaruh negatif dan signifikan terhadap indeks harga saham LQ45. Nilai tukar Rupiah berpengaruh negatif dan signifikan terhadap indeks harga saham LQ45. Secara simultan, suku bunga SBI dan nilai tukar Rupiah berpengaruh signifikan pada $\alpha = 5\%$ terhadap indeks harga saham LQ45.

ABSTRACT

ADAM NURKHOLIK. *The Effect of Bank Indonesia Certificates (SBI) Rate and Exchange Rate on LQ45 Stock Price Index in Indonesian Stock Exchange Year 2005 - 2012. Faculty of Economic State University of Jakarta. 2013.*

The purposes of this study is to know effect of SBI rate and exchange rate on LQ45 Stock Price index in Indonesian Stock Exchange in 2005-2012. This study research method use expose facto. This study use Ordinary Least Square. The result of the regression shows that SBI rate has a negative correlation and significant with LQ45 Stock Price index. Exchange rate has a negative correlation and significant with LQ45 Stock Price index. For the simultan test, SBI rate and exchange rate has a significant correlation on $\alpha = 5\%$ with LQ45 Stock Price Index.