

**PENGARUH INDEKS BURSA GLOBAL TERHADAP INDEKS LQ45
PADA BURSA EFEK INDONESIA PERIODE 2013-2014**

Disusun Oleh :

Erwin Hamonangan Simamora

Dibawah bimbingan :

Drs. Bambang Rismadi, M.Si., Ak.

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh Indeks Global yaitu Indeks DJIA, Indeks Nikkei 225 dan Indeks FTSE100 terhadap pergerakan harga Indeks LQ45 pada Bursa Efek Indonesia (BEI).

Objek yang diteliti adalah Bursa Efek Indonesia yang berlokasi di Jakarta. Penelitian ini menggunakan metode deskriptif dan verifikatif menggunakan data *closed price* Indeks DJIA, Indeks Nikkei 225, Indeks FTSE100 dan Indeks LQ45 secara bulanan mulai Januari 2013 - Desember 2014. Teknik analisis data menggunakan analisis regresi linier berganda dan uji hipotesis dengan menggunakan alat bantu program SPSS 20.

Hasil penelitian menunjukkan secara parsial ketiga indeks berpengaruh signifikan terhadap Indeks LQ45, namun hanya Indeks DJIA yang berpengaruh positif sedangkan Indeks Nikkei 225 dan Indeks FTSE100 berpengaruh negatif. Secara simultan ketiga indeks berpengaruh terhadap Indeks LQ45 dengan kontribusi sebesar 43,7% sedangkan sisanya 56,3% dipengaruhi oleh faktor lain yang tidak diteliti dalam penelitian ini. Penulis menyimpulkan bahwa pergerakan Indeks global mempengaruhi secara signifikan pergerakan dari Indeks LQ45 yang ada di Bursa Efek Indonesia.

Kata kunci : Indeks DJIA, Indeks Nikkei 225, Indeks FTSE100, Indeks LQ45

**THE EFFECT GLOBAL STOCK INDEX TO LQ45 INDEX ON INDONESIA
STOCK EXCHANGE PERIOD 2013-2014**

Author :

Erwin Hamonangan Simamora

Adviser:

Drs. Bambang Rismadi, M.Si., Ak.

ABSTRACT

This study aims to determine the influence of Global Stock Index which DJIA Index, Nikkei 225 Index and FTSE100 Index to price movements LQ45 index on the Indonesian Stock Exchange (BEI).

The object under study is the Indonesia Stock Exchange, located in Jakarta. This research uses descriptive and verification method using data closed price of DJIA index, Nikkei 225 index, FTSE100 index and LQ45 Index monthly began in January 2013 - December 2014. Technical analysis of data using multiple linear regression analysis and hypothesis testing by using the tool SPSS 20.

Partial results showed the three indexes significantly influence the LQ45 index, but only the DJIA Index were positive influence while Nikkei 225 and FTSE100 index negative effect . Simultaneously three indexes affect the LQ45 index with a contribution of 43.7 % while the remaining 56.3 % is influenced by other factors not examined in this study . The authors conclude that the movement of the global index significantly affect the movement of LQ45 index in the Indonesia Stock Exchange.

Keywords : DJIA Index, Nikkei 225 Index, FTSE 100 Index, LQ45 Index