

ABSTRAK

Pengaruh Indeks *Dow Jones Industrial Average* terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) Bursa Efek Indonesia

Oleh : Fani Yuandra/2012

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh Indeks *Dow Jones Industrial Average* terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) Bursa Efek Indonesia.

Penelitian ini tergolong penelitian kausatif. Populasi dalam penelitian ini adalah Indeks *Dow Jones Industrial Average* dan IHSG. Sedangkan sampel penelitian ini ditentukan dengan metode *purposive sampling*. Jadi sampel dari penelitian adalah Indeks *Dow Jones Industrial Average* periode tahun 2005-2010 dan IHSG periode tahun 2005-2010 yaitu 72 bulan. Jenis data yang digunakan adalah data sekunder yang diperoleh dari www.yahoofinance.com. Metode analisis yang digunakan adalah analisis regresi sederhana dengan model persentase perubahan. Untuk pengujian hipotesis menggunakan uji t statistik dengan tingkat α sebesar 5%.

Hasil penelitian ini menyimpulkan bahwa indeks *Dow Jones Industrial Average* berpengaruh positif dan signifikan terhadap IHSG. Saran dalam penelitian ini antara lain (1) bagi investor yang akan melakukan transaksi investasi di BEI untuk memperhatikan Indeks *Dow Jones Industrial Average* karena memberikan pengaruh yang signifikan bagi pergerakan IHSG. (2) bagi penelitian selanjutnya untuk menambah jumlah sampel serta jangka waktu penelitian yang lebih panjang.