

**PENGARUH NILAI TUKAR RUPIAH DAN VOLUME
PERDAGANGAN SAHAM TERHADAP INDEKS SAHAM LQ
45 SAAT TERJADI KRISIS EKONOMI EROPA BULAN
FEBRUARI – JULI 2011**

*THE INFLUENCE OF EXCHANGE RATE AND TRADING
VOLUME ACTIVITY AGAINST INDEX LQ 45 IN EUROPEAN
ECONOMIC CRISIS FEBRUARY - JULY 2011*

**IKHWAN ALIE FIQRIE
8335089526**



**Skripsi ini Ditulis untuk Memenuhi Salah Satu Persyaratan Memperoleh
Gelar Sarjana Ekonomi Pada Fakultas Ekonomi Universitas Jakarta**

**ALIH PROGRAM STUDI S1 AKUNTANSI
JURUSAN AKUNTANSI
FAKULTAS EKONOMI
UNIVERSITAS NEGERI JAKARTA
2011**

LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI



**Penanggung Jawab
Dekan Fakultas Ekonomi**

Nurahma Hajat
Dra. Nurahma Hajat, M.Si
NIP. 19531002 198503 2 001

Nama	Jabatan	Tanda Tangan	Tanggal
1. <u>Dian Citra Aruna, SE, M.Si</u> NIP. 19760908 199903 2 001	Ketua	<i>Dian Citra Aruna</i>
2. <u>Indra Pahala M.Si</u> NIP. 19790208 200812 1 011	Sekretaris	<i>Indra Pahala</i>
3. <u>Ratna Anggraini, SE, M.Akt</u> NIP. 19740417 200012 2 001	Penguji Ahli	<i>Ratna Anggraini</i>
4. <u>M. Yasser Arafat, SE, Akt, MM</u> NIP. 19710413 200112 1 001	Pembimbing I	<i>M. Yasser Arafat</i>
5. <u>Nuramalja Hasanah, M. Ak</u> NIP. 19770617 200812 2 002	Pembimbing II	<i>Nuramalja Hasanah</i>

Tanggal Lulus 17 Januari 2012

PERNYATAAN ORISINALITAS

Dengan ini saya menyatakan:

1. Skripsi ini merupakan Karya asli dan belum pernah diajukan untuk mendapatkan gelar akademik sarjana, baik Universitas Negeri Jakarta maupun Perguruan Tinggi lain.
2. Skripsi ini belum pernah dipublikasikan, kecuali secara tertulis dengan jelas dicantumkan sebagai acuan dalam naskah dengan disebutkan nama pengarang dan dicantumkan dalam daftar pustaka.
3. Pernyataan ini saya buat dengan sesungguhnya dan apabila di kemudian hari terdapat penyimpangan dan ketidakbenaran, maka saya bersedia menerima sanksi akademik berupa pencabutan gelar yang telah saya peroleh, serta sanksi lainnya sesuai dengan norma yang berlaku di Universitas Negeri Jakarta.

Jakarta, 19 Januari 2011
Yang membuat pernyataan



Ikhwani Alie Fiqrie
No Reg : 8335089526

ABSTRAK

Ikhwan Alie Fiqrie, 2012; Pengaruh Nilai Tukar Rupiah Dan Volume Perdagangan Saham Terhadap Indeks Saham Lq 45 Saat Terjadi Krisis Ekonomi Eropa Bulan Februari – Juli 2011.

Penelitian bertujuan untuk menguji pengaruh variabel nilai tukar rupiah dan volume penjualan saham terhadap indeks saham LQ 45 saat terjadi krisis ekonomi Eropa bulan Februari – Juli 2011.

Sampel penelitian ini sebanyak 45 perusahaan yang termasuk kategori LQ 45 selama bulan Februari – Juli 2011 di Bursa Efek Indonesia, dengan metode purposive sampling, jumlah data observasi (n) sebanyak 122, yang merupakan jumlah hari transaksi pada Bursa Efek Indonesia selama periode penelitian.

Hasil penelitian bahwa secara parsial (individu) ada pengaruh yang signifikan antara nilai tukar rupiah dan volume perdagangan saham terhadap indeks saham LQ 45 selama bulan Februari – Juli 2011. Hal ini mengindikasikan bahwa kedua faktor tersebut perlu diperhatikan oleh investor dalam penentuan investasi. Uji F menunjukkan bahwa nilai tukar rupiah dan volume penjualan saham secara simultan juga mempengaruhi indeks saham LQ 45 secara simultan. Variabel independen pada model dapat menjelaskan variasi variabel dependen sebesar 84%.

Kata Kunci : Indeks LQ 45, Nilai Tukar, Volume Perdagangan Saham

ABSTRACT

Ikhwan Alie Fiqrie, 2012; The Influence of Exchange Rate And Trading Volume Activity Against Index LQ 45 In European Economic Crisis February - July 2011.

The research aims to examine the effect of variable exchange rate and volume trading activity of stock index LQ 45 when the economic crisis in Europe from February to July 2011.

This study sample as many as 45 companies including 45 LQ categories during the month of February to July 2011 in the Indonesia Stock Exchange, with purposive sampling method, the amount of observational data (n) 122, which is the number of days on the Indonesia Stock Exchange transactions during the research period.

The results that partially (individual) there is a significant effect between the rupiah and stock trading volume on stock indices LQ 45 during the month of February to July 2011. This indicates that both factors need to be considered by investors in determining investment. F test indicates that the exchange rate and volume trading also affects the simultaneous LQ 45 index stocks simultaneously. Independent variables in the model can explain the variation of the dependent variable by 84%.

Keywords: Index LQ 45, Exchange Rates, Volume Trading Activity

KATA PENGANTAR

Puji syukur praktikan panjatkan kehadiran Allah SWT, Sang Penguasa Alam, karena atas Rahmat dan Hidayah-Nya sehingga penulis dapat menyelesaikan skripsi ini dengan lancar.

Skripsi merupakan salah satu bagian dari perkuliahan yang wajib ditempuh oleh mahasiswa Fakultas Ekonomi Program Studi S1 Akuntansi Universitas Negeri Jakarta untuk memperoleh gelar Sarjana.

Penulis menyadari bahwa selesainya skripsi ini tidak luput dari dorongan dan bantuan semua pihak yang terlibat di dalamnya, maka dengan ini praktikan mengucapkan terima kasih sebanyak-banyaknya kepada :

1. Dra. Nurahma Hajat, M.si selaku Dekan Fakultas Ekonomi.
2. Bapak M. Yasser Arafat selaku Ketua Jurusan Akuntansi dan Dosen Pembimbing skripsi.
3. Ibu Dian Citra Aruna, SE selaku Ketua Program Studi S1 Akuntansi.
4. Ibu Nuramalia, selaku dosen pembimbing.
5. Kedua orang tua yang selalu memberikan doa dan semangat untuk segera menyelesaikan pendidikan Sarjana.
6. Teman-teman selalu mendukung dan memberi bantuan sehingga skripsi ini dapat selesai.

Penulis menyadari dalam penulisan skripsi ini masih banyak terdapat kekurangan dan ketidaksempurnaan karena keterbatasan kemampuan dan

pengetahuan penulis. Oleh karena itu kritik dan saran yang membangun dari pembaca sekalian akan penulis terima dengan tangan terbuka.

Akhir kata semoga penulisan skripsi ini dapat memberikan manfaat bagi pembaca, tanpa kecuali.

Jakarta, Januari 2012
Penulis,

Ikhwan Alie Fiqrie