

ABSTRAK

Tujuan penelitian ini adalah untuk mengetahui dan menganalisis pengaruh nilai tukar dan suku bunga terhadap Indeks Harga Saham Gabungan. Data yang digunakan adalah data time series berupa nilai tukar, suku bunga, dan IHSG periode 2006-2017. Metode analisis data menggunakan analisis regresi linier berganda. Dari analisis regresi linier berganda diperoleh persamaan regresi $Y = 2,489 + 0,586X_1 - 0,688X_2$. Dari uji t dijelaskan bahwa nilai tukar berpengaruh signifikan terhadap Indeks Harga Saham Gabungan, dimana diperoleh nilai $t_{hitung} > t_{tabel}$ ($5,479 > 1,860$) dan nilai t sig. $0,000 < 0,05$. Suku bunga berpengaruh signifikan terhadap Indeks Harga Saham Gabungan, dimana diperoleh nilai $t_{hitung} > t_{tabel}$ ($4,141 > 1,860$) dan nilai t sig. $0,003 < 0,05$. Dari uji F dijelaskan bahwa nilai tukar dan suku bunga secara simultan berpengaruh signifikan terhadap Indeks Harga Saham Gabungan, dimana diperoleh nilai $F_{hitung} > F_{tabel}$ ($24,192 > 4,256$) dan nilai F sig. $0,000 < 0,05$. Dari analisis koefisien determinasi dijelaskan bahwa nilai tukar dan suku bunga mempengaruhi IHSG sebesar 84,3%, sedangkan sisanya sebesar 15,7% dipengaruhi oleh variabel lain yang tidak diteliti dalam penelitian ini.