

PENGARUH INDEKS HARGA SAHAM ASEAN TERHADAP INDEKS HARGA SAHAM GABUNGAN (IHSG) DI BURSA EFEK INDONESIA

Oleh

Eis Ernawati

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk membuktikan secara empiris: (1) Pengaruh *Kuala Lumpur Stock Exchange* (KLSE) terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di Bursa Efek Indonesia. (2) Pengaruh *Strait Times Index* (STI) terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di Bursa Efek Indonesia. (3) Pengaruh *Stock Exchange of Thailand Index* (SETI) terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di Bursa Efek Indonesia. (4) Pengaruh *Philippine Stock Exchange Index* (PSEI) terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di Bursa Efek Indonesia. (5) Pengaruh *Vietnam Ho Chi Minh Stock Index* (VNI) terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di Bursa Efek Indonesia. Data yang digunakan dalam penelitian ini ialah indeks harga saham ASEAN. Populasi yang digunakan dalam penelitian ini adalah negara ASEAN yang mempunyai indeks harga saham tahun periode 2016-2018. Penentuan sampel dilakukan dengan teknik *Purposive Sampling* dan didapat 6 negara dengan periode pengamatan selama 5 tahun dari tahun 2014-2018. Pada penelitian ini menggunakan alat analisis berupa SPSS versi 20. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa *Philippine Stock Exchange Index* (PSEI) berpengaruh terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di Bursa Efek Indonesia. Sedangkan, *Kuala Lumpur Stock Exchange* (KLSE), *Strait Times Index* (STI), *Stock Exchange of Thailand Index* (SETI), dan *Vietnam Ho Chi Minh Stock Index* (VNI) tidak berpengaruh terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di Bursa Efek Indonesia.

Kata kunci : Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG), *Kuala Lumpur Stock Exchange* (KLSE), *Strait Times Index* (STI), *Stock Exchange of Thailand Index* (SETI), *Philippine Stock Exchange Index* (PSEI), dan *Vietnam Ho Chi Minh Stock Index* (VNI).