

ABSTRAK

Risalatul Umami. 1320310001.

Pengaruh Faktor Variabel Makro Ekonomi Terhadap Perubahan Indeks Harga Saham di *Jakarta Islamic Index (JII)* Tahun 2012-2015.

Skripsi, Kudus: Jurusan Syariah dan Ekonomi Islam STAIN Kudus, 2017.

Penelitian ini dilakukan untuk mengetahui apakah terdapat pengaruh inflasi, volume perdagangan saham dan nilai tukar rupiah terhadap indeks harga saham di *Jakarta Islamic Index* periode 2012-2015. Dalam penelitian ini menggunakan metode analisis regresi linier berganda dengan bantuan program SPSS versi 17. Jenis penelitian ini menggunakan *purposive sampling* dengan sampel ($n = 68$). Hasil analisis menunjukkan inflasi tidak berpengaruh terhadap indeks saham di JII karena nilai probabilitas lebih dari $\alpha = 0.05$ ($0.436 > 0.05$), volume perdagangan saham berpengaruh signifikan terhadap indeks harga saham di JII karena nilai probabilitas sebesar 0.000, sedangkan nilai tukar rupiah tidak berpengaruh terhadap indeks harga saham di JII karena nilai probabilitas sebesar 0.503. Semua variabel bebas secara simultan berpengaruh signifikan terhadap indeks harga saham di JII karena hasil perhitungan menggunakan SPSS versi 17 dapat diketahui bahwa nilai F hitung sebesar 10,254 dan nilai probabilitas sebesar 0.000. Jadi, secara simultan nilai $F_{hitung} > F_{tabel}$ atau $10.254 > 2.75$ yang berarti variabel bebas secara bersama-sama berpengaruh signifikan terhadap indeks harga saham di JII.

Kata Kunci: *Inflasi, Volume Perdagangan Saham, Nilai Tukar Rupiah, dan Indeks Harga Saham*