

ABSTRAK

Hartono (2007 – 11 – 075). *Analisis Pengaruh Pergerakan Indeks Global (DJI, HSI, NKY 225, FTSE 100 & STI) Terhadap IHSG BEI Sebelum, Ketika, dan Sesudah Peristiwa Subprime Mortgage.* (Dibimbing oleh Pak Sapto Jumono)

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui pengaruh pergerakan indeks Global (DJI, HSI, NKY 225, FTSE 100 & STI) terhadap. Sampel yang digunakan dalam penelitian ini adalah data-data pergerakan harian dari indeks global yaitu DJI, HSI, NKY, FTSE 100 dan STI pada saat sebelum, ketika, dan sesudah peristiwa *subprime mortgage* pada tahun 2005 sampai dengan 2010.

Berdasarkan hasil penelitian analisis regresi berganda menunjukkan indeks DJI, HSI, dan STI mempengaruhi IHSG secara positif dan NKY dan FTSE 100 tidak memiliki pengaruh pada saat periode sebelum peristiwa *subprime mortgage*. Analisis berganda menunjukkan indeks DJI, HSI, dan STI mempengaruhi IHSG secara positif dan NKY dan FTSE 100 tidak memiliki pengaruh pada saat periode ketika peristiwa *subprime mortgage*. Analisis berganda menunjukkan indeks HSI memiliki pengaruh negatif terhadap IHSG, NKY dan STI memiliki pengaruh positif terhadap IHSG dan DJI serta FTSE tidak memiliki pengaruh pada saat periode sesudah *subprime mortgage*

Kata kunci : Indeks Harga Saham Gabungan, DJI, HSI, NKY, FTSE 100, dan STI