

ABSTRAK

Penelitian ini menganalisis pengaruh variabel makroekonomi terhadap Volume Perdagangan Saham *Jakarta Islamic Index* (JII). Variabel makro yang digunakan dalam penelitian ini berupa Inflasi, Tingkat Suku Bunga, Nilai tukar rupiah terhadap dollar.

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui hubungan dan pengaruh faktor ekonomi makro yang terdiri dari Inflasi, Tingkat Suku Bunga BI (*BI Rate*), dan nilai Tukar Rupiah Terhadap Dollar digunakan serta Faktor ekonomi makro mana yang berpengaruh secara signifikan terhadap Volume Perdagangan Saham *Jakarta Islamic Index* (JII) periode Desember 2011 sampai dengan November 2015.

Penelitian ini menggunakan metode analisis regresi linear berganda untuk mengetahui besaran pengaruh dan menggunakan analisis koefisien korelasi untuk mengetahui seberapa erat hubungan faktor ekonomi makro terhadap volume perdagangan saham Jakarta Islamic Index (JII)

Hasil penelitian ini Koefisien Korelasi menunjukkan bahwa Volume Perdagangan Saham memiliki hubungan yang sangat lemah dengan inflasi, tingkat suku bunga BI, dan Nilai Tukar Rupiah. Sedangkan hasil dari Regresi Berganda menunjukkan bahwa Volume Perdagangan JII tidak dipengaruhi secara signifikan oleh inflasi, tingkat suku bunga, dan nilai tukar rupiah terhadap dollar, baik secara parsial maupun secara simultan. Berdasarkan koefisien determinasi nilai perolehannya sebesar 2,1%. Dari nilai tersebut dapat diartikan bahwa pengaruh Inflasi, tingkat suku bunga, nilai tukar terhadap dollar Terhadap Volume Perdagangan Saham Jakarta Islamic Index (JII) adalah 2,1%, sedangkan sisanya sebesar 97,9% dipengaruhi oleh faktor lain yang tidak diteliti dalam penelitian ini.

Kata kunci : Inflasi, Suku Bunga, Nilai Tukar terhadap Dollar, Volume Perdagangan Saham *Jakarta Islamic Index* (JII)