

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui perkembangan Indeks Harga Saham Gabungan, Volume Perdagangan Saham dan Harga Saham periode 2008 - 2012. Selain itu, penelitian ini juga bertujuan untuk mengetahui pengaruh Indeks Harga Saham Gabungan dan Volume Perdagangan Saham terhadap Harga Saham baik secara parsial maupun simultan.

Data yang digunakan dalam variabel – variabel penelitian ini merupakan data sekunder dengan menggunakan data bulanan selama tahun 2008 - 2012. Metode analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah analisis deskriptif, analisis koefisien determinasi (R^2) dan analisis regresi linear berganda untuk mengetahui hubungan secara parsial maupun simultan yang sebelumnya dilakukan pengujian asumsi klasik terlebih dahulu.

Hasil menunjukkan bahwa secara parsial Indeks Harga Saham Gabungan berpengaruh secara positif terhadap Harga Saham sedangkan Volume Perdagangan Saham tidak berpengaruh secara negatif terhadap Harga Saham. Secara Simultan Indeks Harga Saham Gabungan dan Volume Perdagangan berpengaruh signifikan secara positif terhadap Harga Saham. Besarnya Koefisien Determinasi adalah 0,93 yang berarti variabel independen dapat menjelaskan 93 % variabel dependen.

***Keywords* : Indeks Harga Saham Gabungan, Volume Perdagangan Saham, Harga Saham.**