

ABSTRAK

Metode *Principal Component Analysis* dengan tigabelas variabel yang didalamnya terdapat faktor-faktor makro yaitu Inflasi, Kurs, BI 7-Day (Reverse) Repo Rate, The Fed, GDP Perkapita, Harga Minyak Dunia, Uang Beredar M_1 dan M_2 , Indeks Malaysia, Singapura, Jepang, Hongkong dan Dow Jones, dilakukan untuk melihat faktor makro apa saja yang dominan di Indonesia, dengan PCA dapat membentuk kelompok dengan karakteristik yang sama secara bersama. Dilakukannya analisis dengan metode ini agar dapat melihat secara lebih komprehensif baik itu secara lokal maupun global untuk meminimalisir risiko yang terjadi pada perekonomian di Indonesia, terutama dalam dunia pasar modal. Hasil dari penelitian ini melahirkan 5 variabel baru dari 13 variabel sebelumnya, tanpa menghilangkan karakteristik dari variabel sebelumnya/aslinya.

Kata kunci: Analisis Komponen Utama, Ekonomi Makro, Indeks Harga Saham, Faktor-Faktor Makro.

ABSTRACT

Principal Component Analysis method with thirteen variables in which there are macro factors, namely inflation, exchange rates, BI 7-Day (Reverse) Repo Rate, The Fed, GDP per capita, World Oil Prices, Money Supply M_1 and M_2 , Malaysia, Singapore Index, Japan, Hong Kong and Dow Jones, was carried out to see what macro factors were dominant in Indonesia with the PCA being able to form the same group together. The analysis is carried out using this method in order to see in more detail both locally and globally in order to minimize the risks that occur in the economy in Indonesia, especially in the world capital market. The results of this study gave birth to 5 new variables from the previous 13 variables, without calculating the previous variables.

Keywords: Principal Component Analysis, Economy Macro, Stock Price Index, Macro Factors.