

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERSETUJUAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRACT.....	vi
ABSTRAK.....	vii
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR GAMBAR.....	xi
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiii
BAB 1 PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	5
1.3 Tujuan Penelitian	5
1.4 Manfaat Penelitian	6
1.5 Sistematika Skripsi	6
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA	9
2.1 Landasan Teori	9
2.1.1 Perdagangan Internasional.....	9
2.1.2 Nilai Tukar atau Kurs (<i>Exchange Rate</i>).....	10
2.1.2.1 Risiko (Eksposur) Nilai Tukar	12

2.1.2.2	Penentuan Nilai Tukar	15
2.1.2.3	Faktor Yang Mempengaruhi Nilai Tukar	17
2.1.3	<i>Return</i> Saham.....	19
2.1.3.1	Faktor Yang Mempengaruhi <i>Return</i> Saham	20
2.1.3.2	<i>Return On Assets</i> (ROA).....	23
2.1.3.3	<i>Debt To Equity Ratio</i> (DER).....	23
2.1.3.4	Ukuran Perusahaan (<i>Firm Size</i>)	24
2.2	Penelitian Sebelumnya.....	24
2.3	Perumusan Hipotesis	29
2.4	Kerangka Konseptual.....	31
BAB 3	METODE PENELITIAN	32
3.1	Pendekatan Penelitian.....	32
3.2	Identifikasi Variabel	32
3.3	Definisi Operasional Variabel	33
3.4	Jenis dan Sumber Data.....	35
3.5	Populasi dan Sampel Penelitian.....	35
3.6	Prosedur Pengumpulan Data.....	36
3.7	Teknik Analisis	37
BAB 4	HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	42
4.1	Gambaran Umum Penelitian.....	42
4.2	Deskripsi Hasil Penelitian.....	44
4.3	Pengujian Hipotesis	46
4.4	Pembahasan	57

BAB 5 PENUTUP	61
5.1 Kesimpulan	61
5.2 Keterbatasan Penelitian	62
5.3 Saran	63

DAFTAR PUSTAKA

DAFTAR LAMPIRAN



DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 2.1 Jenis-Jenis Eksposur Valuta Asing.....	14
Gambar 2.2 Perbedaan Konseptual Tentang Paparan Transaksi, Operasional, dan Translasi Valuta Asing	15
Gambar 2.3 Equilibrium Kurs	16
Gambar 2.4 Hubungan Antara Ukuran Perusahaan Dengan <i>Return</i>	22
Gambar 2.5 Kerangka Konseptual	31
Gambar 4.1 Grafik Normal P-Plot	47
Gambar 4.2 Grafik Scatter Plot	51

DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 4.1 Penentuan Sampel Penelitian.....	42
Tabel 4.2 Distribusi Sampel Penelitian.....	43
Tabel 4.3 Hasil Statistik Deskriptif Variabel Penelitian.....	45
Tabel 4.4 Hasil Uji One-Sample Kolmogorov-Smirnov Test.....	48
Tabel 4.5 Hasil Uji Durbin-Watson.....	49
Tabel 4.6 Hasil Uji Gejala Multikolinearitas.....	50
Tabel 4.7 Koefisien Regresi Linier Berganda.....	52
Tabel 4.8 Koefisien Korelasi dan Determinasi.....	54
Tabel 4.9 Hasil Uji-F (Simultan).....	55
Tabel 4.10 Hasil Uji-T (Parsial).....	56

DAFTAR LAMPIRAN

- Lampiran 1 : Daftar Perusahaan Sampel Penelitian
- Lampiran 2 : Perubahan Nilai Tukar (Δ Kurs) 2012-2014
- Lampiran 3 : *Debt To Equity Ratio* (DER) 2012-2014
- Lampiran 4 : Ukuran Perusahaan (*Firm Size*) 2012-2014
- Lampiran 5 : *Return On Assets* (ROA) 2012-2014
- Lampiran 6 : *Return Saham* 2012-2014
- Lampiran 7 : Statistik Deskriptif
- Lampiran 8 : Uji Normalitas Data
- Lampiran 9 : Uji Autokorelasi
- Lampiran 10 : Uji Multikolinearitas
- Lampiran 11 : Uji Heteroskedastisitas
- Lampiran 12 : Koefisien Regresi Linier Berganda
- Lampiran 13 : Koefisien Korelasi dan Determinasi
- Lampiran 14 : Uji-F
- Lampiran 15 : Uji-T