DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN……..... i

SURAT PERNYATAAN KEASLIAN……. ii

SURAT KETERANGAN PERSETUJUAN PUBLIKASI……. iii

ABSTRAK……. iv

ABSTRACT……... v

KATA PENGANTAR……..... vi

DAFTAR ISI…….....ix

DAFTAR GAMBAR…….. xiv

DAFTAR GRAFIK…….xv

DAFTAR TABEL…….xvi

DAFTAR LAMPIRAN…….. xviii

BAB I PENDAHULUAN……1

1.1 Latar Belakang Penelitian……. 1

1.2 Identifikasi Masalah dan Rumusan Masalah…….8

1.2.1 Identifikasi Masalah…… 8

1.2.2 Rumusan Masalah……..9

1.3 Maksud dan Tujuan Penelitian……..10

1.3.1 Maksud Penelitian……..10

1.3.2 Tujuan Penelitian…… 10

1.4 Kegunaan Penelitian……..10

1.4.1 Kegunaan Praktis…… 10

1.4.2 Kegunaan Akademis…….. 11

1.5 Lokasi dan Waktu Penelitian…… 12

1.5.1 Lokasi Penelitian……12

1.5.2 Waktu Penelitian……13

BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS…….. 14

2.1 Kajian Pustaka…….....14

2.1.1 Nilai Tukar Rupiah Atas Dollar…… 14

2.1.1.1 Faktor – faktor yang mempengaruhi nilai tukar……...…..... 17

2.1.1.2 Sistem Nilai Tukar…….…….... 19

2.1.1.3 Jenis – jenis nilai tukar……..…….....20

2.1.2 Rasio Profitabilitas…… 21

2.1.3 Return Saham.…… 24

2.1.4 Hasil Penelitian Terdahulu……26

2.2 Kerangka Pemikiran……..32

2.2.1 Teori Penghubung Nilai Tukar Rupiah Atas Dollar Terhadap Return Saham……..33

2.2.2 Teori Penghubung Rasio Profitabilitas Terhadap Return Saham…… 36

2.2.3 Teori Penghubung Nilai Tukar Rupiah Atas Dollar dan Rasio Profitabilitas Terhadap Return Saham…….. 38

2.3 Hipotesis……41

BAB III METODOLOGI PENELITIAN…….....42

3.1 Objek Penelitian…… 42

3.2 Metode Penelitian……..45

3.2.1 Desain Penelitian……45

3.2.2 Operasionalisasi Variabel…….....52

3.2.3 Sumber dan Teknik Penentuan Data……..... 54

3.2.3.1 Sumber Data…….....54

3.2.3.2 Teknik Penentuan Data…… 54

3.2.4 Teknik Pengumpulan Data……52

3.2.5 Rancangan Analisis…… 56

3.2.5.1 Analisis Deskriptif/Kualikatif……. 56

3.2.5.2 Analisis Verifikatif/Kuantitatif…… 60

3.2.5.2.1 Analisis Regresi Linear Berganda…… 60

3.2.6 Pengujian Hipotesis……....67

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN…… 71

4.1 Gambaran Umum Perusahaan…….. 71

4.1.1 Sejarah Perusahaan…….73

4.1.2 Struktur Organisasi Perusahaan……96

4.2 Analisis Deskriptif…… 104

4.2.1 Perkembangan Nilai Tukar Rupiah Atas Dollar Pada Perusahaan Sektor Perbankan Yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2011-2015……..... 105

4.2.2 Perkembangan Tingkat Pengembalian Ekuitas (ROE) Pada Perusahaan Sektor Perbankan Yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2011-2015……..... 109
4.2.3 Perkembangan Return Saham Pada Perusahaan Sektor Perbankan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2011-2015……. 119
4.3 Analisis Verifikatif…….. 128
4.3.1 Analisis Regresi Linear Berganda……. 129
4.3.2 Uji Asumsi Klasik……. 130
4.3.3 Analisis Korelasi……..... 136
4.3.3.1 Hasil Analisis Korelasi Parsial X1 Terhadap Y…….. 137
4.3.3.2 Hasil Analisis Korelasi Parsial X2 Terhadap Y…….. 138
4.3.3.3 Hasil Analisis Korelasi Simultan X1 dan X2 Terhadap Y…….. 139
4.3.4 Analisis Koefisien Determinasi……..... 140
4.3.5 Pengujian Hipotesis…….. 142
4.3.5.1 Uji Hipotesis Secara Parsial……... 142
4.3.5.2 Uji Hipotesis Secara Simultan……... 147
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN…….. 149
5.1 Kesimpulan……. 149
5.2 Saran……..……. 150

DAFTAR PUSTAKA……152

DAFTAR RIWAYAT HIDUP……..154