

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR GAMBAR	ix
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
ABSTRAK	xii
<i>ABSTRACT</i>	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah.....	5
1.3. Tujuan Penelitian	6
1.4. Manfaat Penelitian	7
1.5. Lingkup Penelitian.....	8
1.6. Sistematika Penulisan	8
BAB II LANDASAN TEORI.....	10
2.1. Landasan Teori	10
2.1.1. Return Investasi.....	10
2.1.2. Resiko Investasi	11
2.1.3. Definisi Profitabilitas	13
2.1.4. Definisi Nilai Tukar Mata Uang (<i>Exchange Rate</i>).....	14

2.1.5. Definisi Eksposur Nilai Tukar (<i>Currency Exposure</i>)	19
2.2. Kajian Penelitian Terdahulu	21
2.3. Perumusan Hipotesis	23
2.4. Kerangka Pemikiran	25
BAB III METODE PENELITIAN	26
3.1. Data dan Sampel.....	26
3.2. Instrumen Penelitian	27
3.2.1. Variabel dan Definisi Operasional.....	27
3.3. Metode Analisis Data	31
3.3.1. Pengujian Hipotesis	33
3.3.2. Uji Asumsi Klasik	34
3.3.2.1. Uji Normalitas	34
3.3.2.2. Uji Multikolinieritas	34
3.3.2.3. Uji Autokorelasi	34
3.3.2.4. Uji Heteroskedastisitas	35
3.3.3. Uji Koefisien Determinasi	35
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	36
4.1. Deskripsi Data	36
4.2. Uji Asumsi Klasik	37
4.2.1. Uji Normalitas	37
4.2.2. Uji Multikolinearitas.....	38
4.2.3. Uji Autokolerasi.....	38
4.3. Uji Signifikansi Koefisien	39

4.3.1. Uji F	40
4.4. Pembahasan	41
4.4.1. Pengaruh Nilai Tukar Rupiah terhadap Return Saham.....	41
4.4.2. Pengaruh Nilai Tukar Rupiah terhadap Profitabilitas Perusahaan	44
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	47
5.1. Kesimpulan	47
5.2. Keterbatasan Penelitian.....	48
5.3. Saran	48
5.4. Implikasi Penelitian	48
DAFTAR PUSTAKA	50

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1. Grafik Kurs Rupiah Terhadap US Dollar Selama 5 Tahun Terakhir	3
Gambar 2.1. Hubungan Antar Variabel.....	25

DAFTAR TABEL

Tabel 4.1.	Pengujian Statistik Deskriptif Variabel Penelitian	37
Tabel 4.2.	Hasil Uji VIF	38
Tabel 4.3.	Tabel Pengujian Autokorelasi Model 1	39
Tabel 4.4.	Tabel Pengujian Autokorelasi Model 2	39
Tabel 4.5.	Hasil Pengujian Uji F Model 1	40
Tabel 4.6.	Hasil Pengujian Uji F Model 2	40
Tabel 4.7.	Hasil Uji Regresi Model 1	41
Tabel 4.8.	Hasil Uji Regresi Model 2	44

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. Sampel Perusahaan	52
Lampiran 2. Hasil Uji Regresi Model Pertama	54
Lampiran 2. Hasil Uji Regresi Model Kedua	55