

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERSETUJUAN	iii
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
ABSTRAKSI	vi
ABSTRACT.....	vii
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR GAMBAR.....	xi
DAFTAR TABEL	xii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan dan Batasan Masalah.....	5
1.2.1. Rumusan Masalah.....	5
1.2.2. Batasan Masalah	6
1.3. Tujuan Penelitian.....	6
1.4. Manfaat Penelitian.....	7
1.5. Sistematika Penulisan.....	8
BAB II KAJIAN PUSTAKA.....	10
2.1. Landasan Teori.....	10
2.1.1. Nilai Tukar Mata Uang	10
2.1.2. Pasar Modal	14
2.1.3. Return Saham.....	19
2.1.4. Tingkat Suku Bunga	20

2.1.5.	Indeks Dow Jones	21
--------	------------------------	----

2.2.	Penelitian terdahulu	22
------	----------------------------	----

2.3.	Kerangka Pemikiran dan Pengembangan Hipotesis	23
------	---	----

2.3.1.	Pengaruh Perubahan Nilai Tukar Terhadap Return Pasar Saham di Indonesia	
--------	---	--

24

BAB III METODE PENELITIAN 27

3.1.	Data dan Sample Penelitian	27
------	----------------------------------	----

3.2.	Sumber Data dan Teknik Pengumpulan Data	27
------	---	----

3.3.	Variabel Penelitian, Definisi Operasional, dan Pengukuran Variabel	28
------	--	----

3.3.1	Variabel Penelitian	28
-------	---------------------------	----

3.3.2	Definisi Operasional dan Pengukuran Variabel	28
-------	--	----

3.3.	Teknik Analisis Data	31
------	----------------------------	----

3.3.1.	Uji Asumsi Klasik	31
--------	-------------------------	----

3.3.2.	Uji Stasioneritas	33
--------	-------------------------	----

3.3.3.	Regresi	33
--------	---------------	----

3.3.4.	Uji Hipotesis	34
--------	---------------------	----

BAB IV ANALISA DAN PEMBAHASAN 37

4.1.	Statistik Deskriptif	37
------	----------------------------	----

4.2.	Uji Asumsi Klasik	41
------	-------------------------	----

4.2.1.	Uji Multikolinearitas	41
--------	-----------------------------	----

4.2.2.	Uji Heteroskedastisitas	42
--------	-------------------------------	----

4.2.3.	Uji Autokorelasi	43
--------	------------------------	----

4.3.	Uji Stasioneritas	43
------	-------------------------	----

4.4.	Uji Signifikansi Koefisien	45
------	----------------------------------	----

4.4.1.	Uji F	45
--------	-------------	----

4.4.2. Uji T.....	46
4.5. Pembahasan.....	48
4.5.1. Pengaruh Negatif Perubahan Nilai Tukar terhadap Return Pasar Saham di Indonesia.....	49
4.5.2. Fluktuasi Nilai Tukar Tidak Berpengaruh secara Signifikan terhadap Return Pasar Saham di Indonesia.....	51
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	54
5.1. Kesimpulan Penelitian.....	54
5.2. Keterbatasan Penelitian.....	55
5.3. Saran Penelitian.....	55
DAFTAR PUSTAKA.....	57
LAMPIRAN.....	59