

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
KATA PENGANTAR	iii
DAFTAR ISI	v
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang	1
B. Pembatasan Masalah	7
C. Perumusan Masalah	7
D. Tujuan Penelitian	8
E. Manfaat Penelitian	8
F. Sistematika Masalah	9

BAB II LANDASAN TEORI	11
A. Return Saham	11
B. Nilai Tukar Uang	12
C. Suku Bunga	15
D. Kerangka pemikiran teoritis dan perumusan Hipotesis	18
1. Pengaruh Nilai Tukar Uang Terhadap <i>Return</i> Saham	18
2. Pengaruh Tingkat Suku Bunga Terhadap <i>Return</i> Saham	20
E. Hipotesis.....	22
 BAB III METODE PENELITIAN	 23
A. Data	23
B. Populasi dan Sampel	23
C. Metode Pengumpulan data.....	24
D. Metode Analisis Data.....	24
1. Uji Asumsi Dasar	25
2. Uji Asumsi Klasik	25
3. Uji Hipotesis	28
E. Definisi Operasional	31

BAB IV GAMBARAN UMUM OBYEK PENELITIAN	32
A. Bursa Efek Indonesia	32
1. Sejarah	32
2. Visi dan Misi	35
B. PT. Gudang Garam, Tbk	35
1. Perkembangan harga saham PT. Gudang Garam,Tbk	36
2. Perkembangan Nilai rupiah terhadap dolar US\$ (Kurs)	39
3. Perkembangan Suku bunga Deposito.....	40
 BAB V PEMBAHASAN MASALAH	 43
A. Deskripsi Data & Objek Penelitian	43
1. Perkembangan Return saham PT. Gudang Garam,Tbk	43
2. Perkembangan Apresiasi/Depresiasi Kurs Rp/US\$	46
3. Perkembangan Suku bunga Deposito	46
B. Uji Asumsi Dasar	49
C. Uji Asumsi Klasik	51
1. Uji Multikoleniaritas	51
2. Uji Autokorelasi	52
3. Uji Heterokedastisitas	54

D. Analisis Dan Pembahasan Model Regresi	56
1. Interpretasi Model Regresi	56
2. Uji Koefisien Determinasi	57
3. Uji Parsial Dengan T-Test	58
4. Uji Simultan dengan uji F Test	60
BAB VI KESIMPULAN DAN SARAN	62
A. Kesimpulan	62
B. Saran	63

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN-LAMPIRAN