

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERSETUJUANSKRIPSI.....	iii
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	iv
PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI.....	v
PERNYATAAN PERSETUJUAN PUBLIKASI KARYA ILMIAH	vi
ABSTRAK.....	vii
ABSTRACT.....	viii
INTISARI	ix
KATA PENGANTAR	x
DAFTAR ISI.....	xii
DAFTAR TABEL.....	xv
DAFTAR GAMBAR	xvi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	8
1.3 Tujuan Penelitian.....	9
1.4 Manfaat Penelitian.....	9
BAB II 11 KAJIAN PUSTAKA.....	11
2.1 Landasan teori	11
2.1.1 <i>Return</i> Saham.....	11
2.1.2 Risiko Investasi Saham	12
2.1.3 Nilai Tukar Rupiah	15
2.1.4 Struktur Modal	16
2.1.5 Likuiditas Perusahaan	17
2.2 Pengembangan Hipotesis	19
2.2.1 Pengaruh Nilai Tukar Rupiah terhadap Risiko Investasi Saham.....	19

2.2.2 Pengaruh Struktur Modal terhadap Risiko Investasi Saham.....	20
2.2.3 Pengaruh Likuiditas Perusahaan terhadap Risiko Investasi Saham.....	21
2.2.4 Pengaruh Nilai Tukar Rupiah terhadap <i>Return</i> Saham.....	22
2.2.5 Pengaruh Struktur Modal terhadap <i>Return</i> Saham	23
2.2.6 Pengaruh Likuiditas Perusahaan terhadap <i>Return</i> Saham	24
2.2.7 Pengaruh Risiko Investasi Saham terhadap <i>Return</i> Saham	25
2.3 Model Empirik	26
BAB III METODE PENELITIAN	27
3.1 Jenis Penelitian	27
3.2 Populasi dan Sampel	27
3.3 Sumber dan Metode Pengumpulan Data	30
3.4 Variabel dan Indikator	30
3.4.1 <i>Return</i> Saham.....	30
3.4.2 Nilai Tukar Rupiah	30
3.4.3 Struktur Modal (DER)	31
3.4.4 Likuiditas Perusahaan (CR)	31
3.4.5 Risiko Investasi	31
3.5 Teknik Analisis.....	33
3.5.1 Analisis Statistik Deskriptif	33
3.5.2 Analisis Jalur (<i>path analysis</i>).....	34
3.5.3 Uji Asumsi Klasik.....	35
3.5.4 Uji Hipotesis	38
3.5.5 Uji Sobel Test	39
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	40
4.1. Deskripsi Penelitian.....	40
4.1.1 Analisis Deskriptif Variabel.....	40
4.2. Hasil Penelitian.....	52
4.2.1 Persamaan Regresi dengan Metode Path Analysis	52
4.2.2 Pengujian Hipotesis	55
4.2.3 Uji Koefisien Determinasi	59

4.2.4 Uji Sobel Test	60
4.3. Pembahasan	65
4.3.1 Pengaruh Nilai Tukar Rupiah terhadap Risiko Investasi Saham.....	65
4.3.2 Pengaruh Struktur Modal terhadap Risiko Investasi Saham.....	66
4.3.3 Pengaruh Likuiditas Perusahaan terhadap Risiko Investasi Saham.....	67
4.3.4 Pengaruh Nilai Tukar Rupiah terhadap Return Saham.....	68
4.3.5 Pengaruh Struktur Modal terhadap Return Saham	70
4.3.6 Pengaruh Likuiditas Perusahaan terhadap Return Saham	72
4.3.7 Pengaruh Risiko Investasi terhadap Return Saham	73
4.3.8 Pengaruh Langsung dan Tidak Langsung.....	74
BAB V PENUTUP	76
5.1 Kesimpulan.....	76
5.2 Saran.....	77
5.3 Keterbatasan Penelitian	77
5.4 Implikasi untuk Penelitian Selanjutnya	78
DAFTAR PUSTAKA	79
LAMPIRAN.....	82

DAFTAR TABEL

Tabel. 3.1	Kriteria Pemilihan Sampel.....	28
Tabel 3.2	Sampel Penelitian	29
Tabel 3.3	Operasional Variabel	32
Tabel 4.1	Data Nilai Tukr Rupiah	40
Tabel 4.2	Data Struktur Modal	42
Tabel 4.3	Data Likuiditas Perusahaan	43
Tabel 4.4	Data Risiko Investasi	44
Tabel 4.5	Data Return Saham	46
Tabel 4.6	Uji Normalitas Data.....	48
Tabel 4.7	Uji Multikolonieritas	49
Tabel 4.8	Uji Autokorelasi.....	50
Tabel 4.9	Uji Heterokedastisitas (Uji Glejser).....	52
Tabel 4.10	Rangkuman Hasil Persamaan Regresi	53
Tabel 4.11	Rangkuman koefisien determinasi.....	59

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran Teoritis	26
Gambar 4.1 Uji Normalitas Grafik P-Plot	47
Gambar 4.2 Uji Heterokedastisitas	51
Gambar 4.3 Hasil Analisis Jalur Antar Variabel	61
Gambar 4.4 Efek Mediasi Nilai Tukar Rupiah terhadap Return Saham melalui Risiko Investasi Saham	61
Gambar 4.5 Efek Mediasi Struktur Modal terhadap Return Saham melalui Risiko Investasi Saham	63
Gambar 4.6 Efek Mediasi Likuiditas terhadap Return Saham melalui Risiko Investasi Saham	64