# PENGARUH NILAI TUKAR, SUKU BUNGA, DAN INFLASI TERHADAP RETURN SAHAM

Studi Kasus Pada Perusahaan Perbankan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia

## **SKRIPSI**

ditulis dan diajukan untuk memenuhi syarat ujian akhir guna memperoleh gelar sarjana strata-1 di Program Studi Manajemen, Fakultas Ekonomi, Universitas

Islam Indonesia

Oleh:

Nama : Larasati Dwi Cendikiana Puri

Nomor Mahasiswa : 15311188

Program Studi : Manajemen

Bidang Konsentrasi : Keuangan

UNIVERSITAS ISLAM INDONESIA FAKULTAS EKONOMI YOGYAKARTA 2019

#### PERYATAAN BEBAS PLAGIARISME

"Dengan ini saya menyatakan bahwa dalam skripsi ini tidak terdapat karya yang diajukan oleh orang lain untuk memperoleh gelar kesarjanaan di suatu perguruan tinggi, dan sepanjang pengetahuan saya juga tidak terdapat karya atau pendapat yang pernah ditulis atau diterbitkan oleh orang lain, kecuali yang secara tertulis diacu dalam naskah ini dan disebutkan dalam referensi. apabila kemudian hari terbukti bahwa pernyataan ini tidak benar, saya sanggup menerima hukuman atau sanksi apapun sesuai peraturan yang berlaku"

Yogyakarta, 20 Juli 2019

Penulis,

### HALAMAN PENGESAHAN SKRIPSI

Pengaruh Nilai Tukar, Suku Bunga, dan Inflasi Terhadap Return Saham

Studi Kasus Pada Perusahaan Perbankan Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia

ISLAM

Nama : Larasati Dwi Cendikiana Puri

Nomor Mahasiswa : 15311188

Program Studi Manajemen

Bidang Konsentrasi : Keuangan

Yogyakarta,

2019

Telah disetujui dan disahkan oleh

Dosen Pembibing

Dr. Dwiprapto Agus Harjito, M.si

#### BERITA ACARA UJIAN TUGAS AKHIR /SKRIPSI

#### SKRIPSI BERJUDUL

PENGARUH NILAI TUKAR, SUKU BUNGA, DAN INFLASI TERHADAP RETURN SAHAM STUDI KASUS PADA PERUSAHAAN PERBANKAN YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK

Disusun Oleh

LARASATI DWI CENDIKIANA PURI

Nomor Mahasiswa

15311188

Telah dipertahankan di depan Tim Penguji dan dinyatakan LULUS

Pada hari Selasa, tanggal: 6 Agustus 2019

Penguji/ Pembimbing Skripsi : Dwi Praptono Agus Hardjito, Dr., M.Si., CFP.

Penguji

: Abdur Rafik, SE., M.Sc.

Mengetahui Dekan Fakultas Ekonomi

Universitas Islam Indonesia

yann, SE., M.Si, Ph.D.

# **HALAMAN MOTTO**

"Sukses adalah sebuah perjalanan, bukan sebuah tujuan. Usaha sering lebih penting daripada hasilnya

(Arthur Ashe)

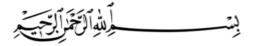
"The Journey of a thousand miles begins with one step"

"Be smart as you can, but remember that it is always better to be wise than to be smart"

(Lao Tzu)

(Alan Alda)

#### **KATA PENGANTAR**



Segala puji syukur kehadirat Allah SWT atas limpahan rahmat dan karuniaNya serta salawat dan salam ditujukan kepada junjungan Nabi umat Islam Nabi
Muhammad SAW sehingga penulis dapat menyelesaikan tugas akhir atau skripsi
yang berjudul "Pengaruh Nilai Tukar, Suku Bunga, dan Inflasi Terhadap Return
Saham (Studi Kasus Pada Perusahaan Perbankan yang Terdaftar di Bursa Efek
Indonesia)". Skripsi ini merupakan salah satu syarat yang harus dipenuhi untuk
mencapai gelar sarjana ekonomi pada Jurusan Manajemen, Fakultas Ekonomi,
Universitas Islam Indonesia.

Penulis menyadari bahwa dalam proses penulisan skripsi ini tidak lepas dari dukungan, dorongan, bimbingan serta doa dari pihak-pihak yang berkenan membantu sehingga skripsi ini dapat terselesaikan. Untuk itu perkenankan penulis mengucapkan terimakasih kepada:

- Allah SWT yang telah memberikan kenikmatan dan hidayah-Nya sehingga hamba-Nya dapat menyelesaikan skripsi dengan baik dalam menempuh pendidikan S1.
- Bapak Fathul Wahid, S.T., M.Sc., Ph.D. selaku Rektor Universitas Islam Indonesia.
- Bapak Dr. Jaka Sriyana, S.E., M.Si. selaku Dekan Fakultas Ekonomi Universitas Islam Indonesia.

- 4. Bapak Anjar Priyono, SE., M.Si., Ph.D selaku Ketua Program Studi Manajemen Program Sarjana Universitas Islam Indonesia.
- 5. Bapak Dr. Dwipraptono Agus Harjito, M.Si selaku dosen pembimbing yang telah menyediakan waktu, pikiran, kesabaran dalam memberikan arahan selama proses penyusunan skripsi.
- 6. Bapak Nursya'bani Purnama S.E., M.Si selaku dosen wali.
- 7. Seluruh dosen dan staf program studi Manajemen Fakultas Ekonomi Universitas Islam Indonesia yang telah memberikan ilmu dan pelayanannya.
- 8. Bapak Teguh Edi Riyanto dan Ibu Tuminarsih selaku orangtua yang telah memberikan kasih sayang, dukungan dan doa.
- Nabila Erlisa Rian Umi dan Derinda Febrianti Sakinah selaku kaka dan adek kandung yang selalu memberikan dukungan untuk dapat melangkah kedepan.
- 10. Sahabat ku Ditya Nurkhairina Putri Nizar yang selalu membantuku melalui ini semua
- 11. Sahabat kuliah Ujeng, Laras, Suci, Hapsari, Ida, Rezty, Hastin, dan Alvin yang telah memberikan dukungan dan menjadi teman terbaik.
- 12. Sahabat SMA ku Aldo, Alfian, Rindang, Thoriq, Rara, Icak, Astrie, Rangga, Via, Dila
- 13. Keluarga LEM FE UII khususnya magang yang telah memberikan kesempatan untuk tumbuh dan berkembang.

- 14. Teman-teman KKN Unit PW-319, Faqih , Fira, Aulia, Khalda, Rafi, Dendy dan Boy.
- 15. Semua pihak yang tidak dapat disebutkan satu per satu yang telah memberikan dukungan sehingga penulis dapat menyelesaikan skripsi ini.

Penulis menyadari bahwa penulisan skripsi ini masih jauh dari kata sempurna. Mohon maaf apabila terjadi kesalahan, oleh karenanya kritik dan saran dari pembaca yang sifatnya membangun dapat tersampaikan. Akhir kata, dengan segala kerendahan hati penulis semoga skripsi ini dapat memberikan manfaat bagi pihak-pihak yang membutuhkannya.

Yogyakarta, 10 Juli 2019

Penulis

Larasati Dwi Cendikiana Puri