

**PENGARUH UKURAN PERUSAHAAN, SUKU BUNGA DAN
NILAI TUKAR TERHADAP HARGA SAHAM PERUSAHAAN
INDUSTRI KIMIA YANG TERDAFTAR DI BEI TAHUN
2011 – 2015**

SKRIPSI

**Diajukan Untuk Memenuhi Salah Satu Persyaratan Memperoleh Gelar
Sarjana Ekonomi Pada Fakultas Ekonomi Program Studi Manajemen
Universitas Mercu Buana**



**Oleh :
Yulia Sapharianti
43113310004**

**Program Studi Manajemen
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS
UNIVERSITAS MERCU BUANA
JAKARTA
2017**

SURAT PERNYTAAN KARYA SENDIRI

Yang bertanda tangan dibawah ini :

Nama : Yulia Sapharianti

Nim : 43113310004

Program Studi : SI Manajemen

Menyatakan bahwa skripsi ini adalah murni hasil karya sendiri apabila saya mengutip dari hasil karya orang lain, maka saya mencantumkan sumbernya sesuai dengan ketentuan yang berlaku. Saya bersedia dikenai sanksi pembatalan skripsi ini apabila terbukti melakukan tindakan plagiat (penjiplakan).

Demikian pernyataan ini saya buat dengan sebenarnya.

UNIVERSITAS
MERCU BUANA

Jakarta, 08 Juli 2017



Yulia Sapharianti

NIM : 43113310004

LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI

Nama : Yulia Sapharianti
NIM : 43113310004
Program Studi : S1 Manajemen
Judul Skripsi : Pengaruh Ukuran Perusahaan, Suku Bunga Dan Nilai Tukar Terhadap Harga Saham Perusahaan Industri Kimia Yang Terdaftar Di BEI Tahun 2011 – 2015

Tanggal Lulus Ujian :

Disahkan Oleh :

Pembimbing,

Ketua Penguji,


Nur Aisyah F. Pulungan, SE, MM


Agus Ariyanto, SE, MM

Tanggal : 23 September 2017

Tanggal : 25-09-2017

Dekan,

Ketua Program Studi

S1 Manajemen


Dr. Harnovinsah, M.Si, CA


Dudi Permana, Ph.D, MM.,

Tanggal : 25 September 2017

Tanggal : 25/9-2017

KATA PENGANTAR

Segala puji bagi Allah SWT yang telah memberikan rahmat dan karunia-Nya kepada peneliti, serta terima kasih kepada kedua orang tua tercinta dan kedua adik saya yang telah memberikan semangat, doa dan dukungan moral dan material yang tiada henti – hentinya kepada penulis serta memberi semangat dan memberikan banyak inspirasi dalam menyelesaikan skripsi, sehingga penulis dapat menyelesaikan skripsi ini dengan judul “Pengaruh Ukuran Perusahaan, Suku Bunga Dan Nilai Tukar Terhadap Harga Saham Perusahaan Industri Kimia Yang Terdaftar Di BEI Tahun 2011 – 2015”. Skripsi ini merupakan syarat untuk memperoleh gelar sarjana pada Program Studi Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Mercu Buana.

Penulis menyadari sebagai manusia biasa dalam penelitian ini tidak lepas dari kesalahan dan kekurangan akibat keterbatasan pengetahuan serta pengalaman. Penyusunan skripsi ini tidak lepas dari bimbingan, bantuan dan dukungan yang sangat berarti dari berbagai pihak, khususnya Ibu Nur Aisyah F. Pulungan SE,MM, selaku dosen pembimbing skripsi yang telah memberikan saran, waktu, bimbingan, semangat, pengetahuan dan nasehat – nasehat yang sangat bermanfaat yang telah diberikan kepada penulis. Oleh karena itu, dalam kesempatan ini penulis haturkan alhamdulillah atas kekuatan Allah SWT yang telah mencurahkan anugerahnya dan ingin berterima kasih pada semua pihak yang telah membantu dalam penyusunan skripsi ini terutama kepada:

1. Bapak Dr. Ir. Arisetyanto Nugroho, MM selaku Rektor Universitas Mercu Buana.
2. Bapak Dr. Harnovinsah, M.Si, CA, selaku Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Mercu Buana.
3. Bapak Dudi Permana, Ph.D, MM, Ketua Program Studi Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Mercu Buana.

4. Bapak Muhamad, SE., MM., selaku Sekertaris Program Studi Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Mercu Buana.
5. Seluruh dosen dan staf Program Studi Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Mercu Buana yang telah memberikan segenap ilmunya.
6. Pihak – pihak lain yang tidak bisa penulis sebutkan satu persatu. Terima kasih atas bantuan, motivasi serta doanya.

Penulis menyadari sepenuhnya bahwa skripsi ini masih jauh dari sempurna dikarenakan terbatasnya pengalaman dan pengetahuan yang dimiliki penulis. Oleh karena itu, penulis mengharapkan segala bentuk saran serta masukan bahkan kritik yang membangun dari berbagai pihak. Semoga skripsi ini bermanfaat dan dapat menambah pengetahuan khususnya bagi penulis dan pembaca pada umumnya. Akhir kata dengan segala ketulusan dan kerendahan diri, penulis mohon maaf apabila ada kesalahan dan kelemahan dalam skripsi ini.

Jakarta, 08 Juli 2017

UNIVERSITAS
MERCU BUANA

Yulia Sapharianti

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI.....	ii
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI.....	iii
ABSTRAK.....	iv
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Penelitian.....	1
B. Rumusan Masalah Penelitian.....	8
C. Tujuan dan Kontribusi Penelitian.....	8
1. Tujuan Penelitian.....	8
2. Kontribusi Penelitian.....	9
BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS	
A. Kajian Pustaka.....	11
a. Definisi Saham	11
b. Ukuran Perusahaan.....	14
c. Suku Bunga.....	15

d. Nilai Tukar.....	15
B. Penelitian Terdahulu.....	22
C. Rerangka Pemikiran.....	26
D. Pengembangan Hipotesis.....	26

BAB III METODE PENELITIAN

A. Waktu dan Tempat.....	30
B. Desain Penelitian.....	30
a. Definisi dan Operasional Variabel.....	30
b. Populasi dan Sampel Penelitian.....	33
c. Teknik Pengumpulan Data.....	34
d. Metode Analisa.....	34
1. Analisis Statistik Deskriptif.....	34
2. Uji Asumsi Klasik.....	36
3. Uji Analisis Regresi Linier Berganda.....	40
4. Uji Kesesuaian Model.....	41
5. Uji hipotesis.....	42

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

A. Gambaran Umum Objek Penelitian.....	44
B. Hasil Dan Pembahasan Penelitian.....	46
a. Statistik Deskriptif.....	46
b. Uji Asumsi Klasik.....	48

1. Uji Normalitas.....	48
2. Uji Multikolonieritas.....	50
3. Uji Autokorelasi.....	51
4. Uji Heteroskedastisitas.....	52
c. Hasil Analisis Regresi Linier Berganda.....	53
d. Hasil Uji Kesesuaian Model.....	54
1. Uji Koefisien Determinasi.....	54
2. Uji F Anova.....	56
e. Hasil Uji Hipotesis.....	56
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	
A. Kesimpulan.....	59
B. Saran.....	59
DAFTAR PUSTAKA.....	61
LAMPIRAN	

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Daftar Nilai Tukar Terhadap Dollar US Periode 2011 – 2015.....	5
Tabel 1.2 Daftar Suku Bunga BI Rate Periode 2011 – 2015.....	5
Tabel 1.3 Daftar Harga Saham Perusahaan Industri Kimia Periode 2011 – 2015...7	
Tabel 2.1 Hasil Penelitian Terdahulu.....	22
Tabel 4.1 Hasil Uji Statistik Deskriptif.....	46
Tabel 4.2 Uji Multikolonieritas.....	50
Tabel 4.3 Uji Autokorelasi Durbin Watson.....	51
Tabel 4.4 Hasil Analisis Regresi Linier Berganda.....	53
Tabel 4.5 Uji Koefisien Deteriminasi.....	55
Tabel 4.6 Uji F Anova.....	56
Tabel 4.7 Hasil Uji t.....	57



UNIVERSITAS
MERCU BUANA

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Rerangka Pemikiran.....	26
Gambar 3.1 Kurva Durbin Watson.....	38
Gambar 4.1 Grafik Uji Normalitas.....	49
Gambar 4.2 Grafik Uji Normalitas.....	49
Gambar 4.3 Grafik Uji Heteroskedastisitas.....	52



DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Daftar Sampel Penelitian.....	63
Lampiran 2 Daftar Ukuran Perusahaan Industri Kimia 2011 -2015.....	64
Lampiran 3 Daftar Suku Bunga Tahun 2011 – 2015.....	65
Lampiran 4 Daftar Nilai Tukar Tahun 2011 - 2015.....	66
Lampiran 5 Daftar Harga Saham Perusahaan Industri Kimia 2011 -2015.....	67
Lampiran 6 Uji Hasil Analisa Statistik Deskriptif.....	68
Lampiran 7 Hasil Uji Asumsi Klasik.....	69
Lampiran 8 Hasil Uji Analisa Regresi Linier Berganda.....	71
Lampiran 9 Hasil Uji Analisa Kesesuaian Model.....	72
Lampiran 10 Hasil Uji Hipotesis.....	73



UNIVERSITAS
MERCU BUANA