



MON

 PERPUSTAKAAN	MILIK PERPUSTAKAAN UNIVERSITAS ATMA JAYA YOGYAKARTA
Diterima	21 JAN 2009
Inventarisasi	: 318/IE/Hd.01/2009
Klasifikasi	: 332 Liv 08
Subyek	: Finance

 PERPUSTAKAAN	UNIVERSITAS ATMA JAYA YOGYAKARTA UNIVERSITAS ATMA JAYA YOGYAKARTA FACULTAS EKONOMI PROGRAM STUDI ILMU EKONOMI
---	--

**PENENTUAN NILAI TUKAR RUPIAH DENGAN MENERAPKAN
KONSEP PARITAS DAYA BELI RELATIF PERIODE 2003:1 – 2007:12**

SKRIPSI

Untuk Memenuhi Sebagian Persyaratan Mencapai Derajat Sarjana Ekonomi (S1)

Pada Program Studi Ilmu Ekonomi

Fakultas Ekonomi Universitas Atma Jaya Yogyakarta



Disusun Oleh :

Rr. E. Livia Rizky Saptani Pr.

NPM. 03 11 14381

**FAKULTAS EKONOMI
UNIVERSITAS ATMA JAYA YOGYAKARTA**

Januari, 2009

SKRIPSI

**PENENTUAN NILAI TUKAR RUPIAH DENGAN
MENERAPKAN KONSEP PARITAS DAYA BELI RELATIF
PERIODE 2003:1 – 2007:12**

Disusun Oleh :

Rr. E. Livia Rizky Saptani Pr.

NPM : 03 11 14381

Telah dibaca dan disetujui dengan baik oleh:

Pembimbing Utama,

Kuspradono

(Kuspradono, Dipl-volksw)

Tanggal : 18 Desember 2008

SKRIPSI

**PENENTUAN NILAI TUKAR RUPIAH DENGAN MENERAPKAN
KONSEP PARITAS DAYA BELI RELATIF PERIODE 2003:1 – 2007:12**

Yang dipersiapkan dan disusun oleh :

Rr. E. Livia Rizky Saptani Pr.

NPM : 03 11 14381

Telah dipertahankan di depan panitia penguji pada tanggal 9 Januari 2009

Dan dinyatakan telah memenuhi persyaratan untuk mencapai derajat

Sarjana Ekonomi (S1) Pada Program Studi Ilmu Ekonomi

Fakultas Ekonomi Universitas Atma Jaya Yogyakarta

SUSUNAN PANITIA PENGUJI

Ketua Panitia Penguji


Ag. Edi Sutarta, SE., M. Si

Anggota Panitia Penguji


Sigit Triandaru, SE., M. Si


Kuspradono, Dipl-Volks

Yogyakarta,

Dekan Fakultas Ekonomi

Universitas Atma Jaya Yogyakarta


Maryatno, Dr., MA
EKONOMI

PERNYATAAN

Saya, yang bertandatangan di bawah ini dengan sesungguhnya menyatakan bahwa skripsi dengan judul :

**PENENTUAN NILAI TUKAR RUPIAH DENGAN MENERAPKAN
KONSEP PARITAS DAYA BELI RELATIF PERIODE 2003:1 –
2007:12**

Benar-benar hasil karya saya sendiri. Pernyataan, ide maupun kutipan baik langsung maupun tidak langsung yang bersumber dari tulisan atau ide orang lain dinyatakan secara tertulis dalam skripsi ini dalam catatan kaki / daftar pustaka. Apabila di kemudian hari terbukti bahwa saya melakukan plagiasi sebagian atau seluruhnya dari skripsi ini, maka gelar dan ijazah yang saya peroleh dinyatakan batal dan akan saya kembalikan kepada Universitas Atma Jaya Yogyakarta.

Yogyakarta, 18 Desember 2008

Yang menyatakan,



Rr. E. Livia Rizky Saptani Pr.

MOTTO

- ❖ HIDUP ADALAH SEBUAH PERJUANGAN, TETES KERINGAT DAN AIR MATA YANG JATUH ADALAH CAMBUKAN BAGI KITA.
- ❖ KEJUJURAN ADALAH HARTA YANG TAK TERNILAI HARGANYA DI DUNIA INI.
- ❖ HARI INI ADALAH PENENTU HARI ESOK BAGI KITA.
- ❖ KEPINTARAN, KEKAYAAN DAN KEKUASAAN TAK AKAN BERGUNA JIKA KITA TAK MEMPUYAI IMAN YANG KUAT.

KATA PEGANTAR

Alhamdulillah penulis panjatkan atas berkat dan RahmatNya, bimbingan serta Ridho yang telah diberika dari Allah, SWT sehingga penulis mampu menyelesaikan skripsi yang berjudul “Penentuan Nilai Tukar Rupiah Dengan Menerapkan Konsep PPP Relatif Periode 2003:1 – 2007:12” yang disusun untuk memenuhi tugas dan persyaratan dalam memperoleh gelar sarjana ekonomi pada Fakultas Ekonomi Universitas Atma Jaya Yogyakarta.

Penulis menyadari bahwa dengan selesainya penulisan skripsi ini tidak lepas dari bantuan, doa, dukungan dan semangat yang telah diberikan kepada penulis. Oleh karena itu, penulis ingin mengucapkan banyak terima kasih serta pengharapan kepada :

1. Allah, SWT atas Berkah, Rahmat dan Hidayah yang telah penulis terima dalam kehidupanku.
2. Bapak Kuspradono, Dipl-Volksw selaku dosen pembimbing yang telah sabar menuntun dan mengarahkan penulis terutama dalam membuka pikiran dan wawasan serta untuk segala kemudahan yang telah beliau berikan kepada penulis.
3. Ibu AM. Rini Setyastuti, SE., M. Si selaku Kaprodi Ilmu Ekonomi Fakultas Ekonomi Universitas Atma Jaya Yogyakarta.
4. Bapak Sigit Triandaru, SE dan Bapak Andreas Sukamto, Drs. M. Si selaku dosen pembahas kolokium atas informasi dan pengetahuan yang telah diberikan.
5. Bapak Ag. Edi Sutarta, SE., M. Si, Bapak Sigit Triandaru, SE dan Bapak Kuspradono, Dipl-Volksw selaku panitia penguji atas semua informasi, pengetahuan dan masukan yang telah diberikan.

6. Seluruh staf pengajar yang telah memberikan bekal teori selama menempuh studi.
7. Seluruh karyawan perpustakaan dan bagian pengajaran yang telah memberikan kemudahan fasilitas selama menempuh studi di Fakultas Ekonomi Universitas Atma Jaya Yogyakarta.
8. (Almh) Rr. Ypm. Siti Rahayu, Mamaku tercinta di surga dan Papaku Drs. Ir. R. Fx Saptono Putro, M. Kes, terima kasih atas segala cinta, doa dan kasih sayangmu.
9. Lelaki kecilku, Sheavito Putra Edlee dan suamiku tercinta, Edy Sulisty. Terima kasih atas semua cinta, kasih sayang dan perhatian serta dukungannya.
10. R. V. Aditya Vicky W dan Mbak Dewi serta R. Vinc. Aditya Wira S. W atas semua dukungan dan bantuannya.
11. (Almh) Ibu Pujiyati dan Bapak Suharyanto, mertuaku atas semua dukungan dan doanya.
12. Petrus Eko, SE. Atas semua bantuannya telah memberikan masukan dan semangat dalam proses penyelesaian skripsi ini.
13. Teman-teman IESP angkatan 2003, 2002, 2004, 2005, teman-teman kelas G semester 1 angkatan 2003, teman-teman KKN kelompok 07 Surulanang, Paliyan 2008 (Maya, Ingried, Yasinta, Richo, Ferry, Ade, Aldrin).
14. Semua pihak yang tidak dapat penulis sebutkan satu persatu, yang telah membantu dalam menyelesaikan skripsi ini.

Akhir kata, penulis menyadari bahwa masih banyak kekurangan dan kelemahan yang tidak mungkin bisa dihindarkan. Namun demikian, penulis berharap semoga skripsi ini dapat memberikan manfaat, sumbangan dan inspirasi bagi peneliti selanjutnya terhadap permasalahan yang masih berkaitan.

Penulis,

Rr. E. Livia Rizky Saptani Pr.



DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERSETUJUAN PEMBIMBING.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
HALAMAN MOTTO.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR GRAFIK.....	xiii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiv
INTISARI.....	xv
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	xvi
BAB I. PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang Masalah.....	1
1.2. Rumusan Masalah.....	4
1.3. Tujuan Penelitian.....	4
1.4. Manfaat Penelitian.....	4
1.5. Studi Terkait.....	5
1.6. Hipotesis.....	6
1.7. Metode Penelitian.....	7
1.7.1. Jenis dan Sumber Data.....	7

1.7.2. Metode Analisis Data.....	7
1.7.3. Pengujian Data.....	8
1.7.3.1. Alat Analisis.....	8
1.7.3.2. Pengujian Statistik.....	8
1.7.3.3. Uji Asumsi Klasik.....	11
1.7.3.3.1. Uji Heteroskedastisitas.....	11
1.7.3.3.2. Uji Autokorelasi.....	12
1.7.3.3.3. Uji Multikolinearitas.....	12
1.8. Sistematika Penulisan.....	13
BAB II. LANDASAN TEORI.....	15
2.1. Pengertian Teori Paritas Daya Beli (<i>Purchasing Power Parity</i>).....	15
2.1.1. Paritas Daya Beli Versi Absolut.....	16
2.1.2. Paritas Daya Beli Versi Relatif.....	19
2.2. Definisi dan Fungsi Pasar Uang.....	23
2.3. Definisi Nilai Tukar.....	24
2.4. Teori-teori Kurs / Nilai Tukar.....	26
2.4.1. Pendekatan Perdagangan atau	
Pendekatan Elastisitas Terhadap Pembentukan Kurs.....	26
2.4.2. Teori Paritas Daya Beli Untuk	
Menjelaskan Proses Pembentukan Kurs.....	26
2.4.3. Pendekatan Moneter Terhadap	
Pembentukan Kurs dan Lonjakan Kurs.....	27

2.4.4. Pendekatan Keseimbangan Portofolio

Terhadap Pembentukan Kurs.....	28
2.5. Definisi Indeks Harga Konsumen (IHK/CPI).....	29
BAB III. GAMBARAN UMUM.....	31
3.1. Kebijakan Nilai Tukar.....	31
3.2. Perkembangan Nilai Tukar Rupiah Terhadap Dollar.....	32
3.3. Perkembangan Nilai Tukar Rupiah Terhadap Dollar AS dengan PPP Relatif.....	34
3.4. Perkembangan Indeks Harga Konsumen (IHK/CPI) di Indonesia	35
3.5. Perkembangan CPI Amerika.....	37
BAB IV. HASIL DAN PEMBAHASAN.....	39
4.1. Uji MWD.....	39
4.2. Pengujian Asumsi Klasik.....	42
4.2.1. Pengujian Multikolinearitas.....	42
4.2.2. Perbaikan Multikolinearitas.....	43
4.2.3. Pengujian Autokorelasi.....	45
4.2.4. Pengujian Heteroskedastisitas.....	46
4.3. Pengujian Statistik.....	47
4.3.1. Uji t-statistik.....	48
4.3.2. Uji F.....	48
4.3.3. Pengujian Koefisien Determinasi (R^2).....	48

4.4. interpretasi Ekonomi.....	49
BAB V. KESIMPULAN DAN SARAN.....	51
5.1. Kesimpulan.....	51
5.2. Saran.....	52



DAFTAR TABEL

Tabel 4.1.....	40
Hasil Regresi Z1 dan Z2	
Tabel 4.2.1.....	43
Hasil Pengujian Multikolinearitas	
Table 4.2.2.....	44
Hasil Pengujian Perbaikan Multikolinearitas	
Tabel 4.2.3.....	44
Hasil Pengujian Autokorelasi	
Tabel 4.2.4.....	45
Hasil Pengujian Heteroskedastisitas	
Tabel 4.3.....	47
Hasil Estimasi	

DAFTAR GRAFIK

Grafik 1.1.....	2
Nilai Tukar Aktual Rupiah Terhadap Dolar Amerika Periode 2003:1-2007:12	
Grafik 1.2.....	3
Nilai Tukar Rupiah Terhadap Dolar Amerika Dengan Menggunakan PPP Relatif Periode 2003:1-2007:12	
Grafik 3.2.....	33
Perkembangan Nilai Tukar Rupiah Terhadap Dolar Amerika Periode 2003:1-2007:12	
Grafik 3.3.....	35
Perkembangan Nilai Tukar Rupiah Terhadap Dolar Amerika Dengan Menggunakan Konsep Paritas Daya Beli Periode 2003:1-2007:12	
Grafik 3.4.....	36
CPIINDO Periode 2003:1-2007:12	
Grafik 3.5.....	38
CPIUSA Periode 2003:1-2007:12	

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1.....	49
Data	
Lampiran 2.....	53
Hasil Penyamaan Tahun Dasar CPI* 2002=100	
Lampiran 3.....	63
Hasil Perhitungan PPP Relatif	
Lampiran 4.....	78
Hasil Uji MWD	
Lampiran 5.....	80
Hasil Uji Multikolinearitas	
Lampiran 6.....	81
Hasil Uji Perbaikan Multikolinearitas	
Lampiran 7.....	82
Hasil Uji Heteroskedastisitas	
Lampiran 8.....	83
Hasil Uji Autokorelasi	
Lampiran 9	84
Perbandingan nilai tukar aktual dengan nilai tukar PPP relatif	
Lampiran 10.....	85
Hasil Fitted Regresi	

**PENENTUAN NILAI TUKAR RUPIAH DENGAN MENERAPKAN
KONSEP PARITAS DAYA BELI RELATIF PERIODE 2003:1 – 2007:12**

Disusun Oleh :

Rr. E. Livia Rizky Saptani. Pr.

NPM : 03 11 14381

Pembimbing

Kuspradono, Dipl-volksw

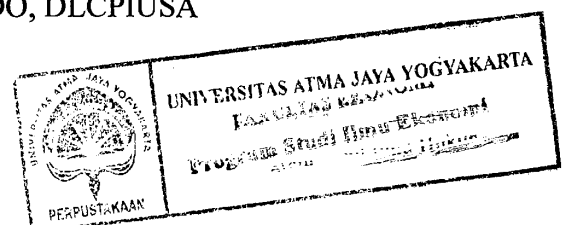
Intisari

Seiring dengan meningkatnya perdagangan internasional maka penggunaan valuta asing sebagai alat pembayaran juga semakin meningkat. Nilai suatu komoditi dalam perdagangan internasional di Indonesia ditentukan dalam satuan mata uang Rupiah sebagai mata uang domestik dan salah satunya adalah dolar Amerika sebagai mata uang luar negeri, sehingga nilai tukar Rupiah terhadap dolar atau valuta asing lainnya menjadi alat penting dalam perdagangan internasional.

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui dan menganalisis perbandingan nilai tukar rupiah Indonesia terhadap dolar Amerika dengan menggunakan konsep teori paritas daya beli relatif periode 2003:1 – 2007:12. Metode penelitian yang digunakan adalah menggunakan alat analisis OLS (*Ordinary Least Square*) Regresi Log Linier.

Hasil yang diperoleh dari penelitian ini adalah, bahwa hasil regresi tidak menolak H_0 dimana $DLCPIINDO$ dan $DLCPIUSA$ mempengaruhi nilai tukar rupiah dan mempunyai hubungan yang signifikan dengan nilai tukar. Hal itu ditunjukkan dengan CPI keduanya terdeferensial. Jika inflasi naik terus maka orang akan melakukan substitusi mata uang dimana mereka akan menjual rupiah dan membeli dolar, demikian juga sebaliknya.

Kata Kunci : PPP relatif, nilai tukar, $DLCPIINDO$, $DLCPIUSA$



SKRIPSI INI KU PERSEMBAHKAN UNTUK :

- ✓ Allah, **SUB** atas semua hidayah-Nya
- ✓ Almh. **Mamaku** TERCINTA di SURGA (REST IN PEACE) MAMA SELALU MENJADI TELADANKU
- ✓ **Papa-ku** tersayang, terima kasih atas semua doa papa
- ✓ My Little Hero, **Sheavito Putra Edlee**, kau tujuan hidup Bunda. Jadilah Lelaki Kebanggaan Ayah-Bunda
- ✓ My Beloved, **Edy Sulistyono**, thx for all, **inu inu inu**
- ✓ Mas Vicky dan Mbak Dewi, de' Adit dan (almh) de' Mitha