

**ANALISIS FAKTOR-FAKTOR PENENTU PERUBAHAN
NILAI TUKAR RUPIAH SELAMA KRISIS GLOBAL
(PERIODE 2006-2013)**

SKRIPSI

OLEH

EDI GUNAWAN
NIM. 11071102337



UIN SUSKA RIAU

PROGRAM S1

JURUSAN MANAJEMEN KEUANGAN

**FAKULTAS EKONOMI DAN ILMU SOSIAL
UNIVERSITAS ISLAM NEGERI
SULTAN SYARIF KASIM RIAU
PEKANBARU
2014**

**ANALISIS FAKTOR-FAKTOR PENENTU PERUBAHAN
NILAI TUKAR RUPIAH SELAMA KRISIS GLOBAL
(PERIODE 2006-2013)
SKRIPSI**

Diajukan Sebagai Salah Satu Syarat Untuk Mengikuti Ujian Oral
Comprehensive Strata 1 Pada Fakultas Ekonomi dan Ilmu Sosial
Universitas Islam Negeri Sultan Syarif Kasim Riau

OLEH

EDI GUNAWAN
NIM : 11071102337



UIN SUSKA RIAU

**PROGRAM S1
JURUSAN MANAJEMEN**

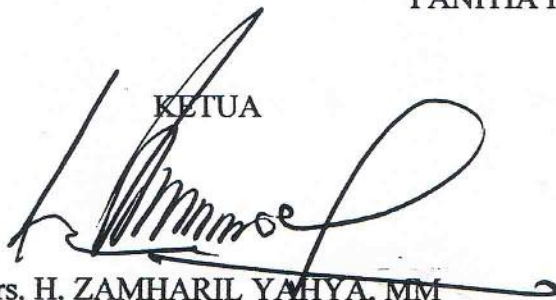
**FAKULTAS EKONOMI DAN ILMU SOSIAL
UNIVERSITAS ISLAM NEGERI
SULTAN SYARIF KASIM RIAU
PEKANBARU
2014**

LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI

NAMA : EDI GUNAWAN
NIM : 11071102337
FAKULTAS : EKONOMI DAN ILMU SOSIAL
JURUSAN : MANAJEMEN SI
JUDUL : ANALISIS FAKTOR-FAKTOR PENENTU PERUBAHAN
NILAI TUKAR RUPIAH SELAMA KRISIS GLOBAL
(PERIODE 2006-2013).

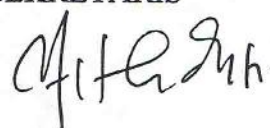
PANITIA PENGUJI

KETUA



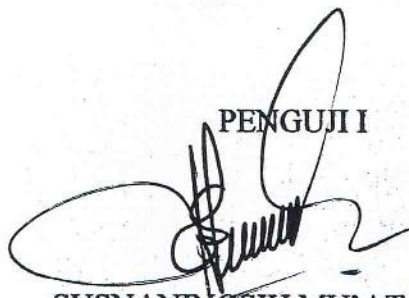
Drs. H. ZAMHARIL YAHYA, MM
NIP. 19520615 198103 1 003

SEKRETARIS



FITRI HIDAYATI, SE, MM
NIK. 130411018

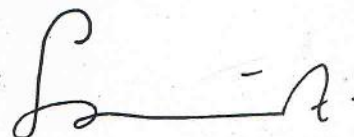
PENGUJI I



SUSNANINGSIH MU'AT, SE, MM
NIP. 19730909 200604 2 001

MENGETAHUI

PENGUJI II



LUSIAWATI, SE, MBA
NIP. 150 424 335

ABSTRAK

ANALISIS FAKTOR-FAKTOR PENENTU PERUBAHAN NILAI TUKAR RUPIAH SELAMA KRISIS GLOBAL (PERIODE 2006-2013).

Oleh:

Edi Gunawan

Nim: 11071102337

Penelitian ini bertujuan untuk meneliti faktor-faktor penentu nilai tukar rupiah selama krisis global. Variabel yang digunakan dalam penelitian ini yaitu Pendapatan rill, inflasi, dan tingkat suku bunga sebagai variabel independent dan nilai tukar rupiah sebagai variabel dependent. Berdasarkan uji koefisien determinasi diketahui bahwa variabel bebas (pendapatan rill, inflasi dan suku bunga) berpengaruh terhadap variabel terikat (nilai tukar) sebesar 0,605 atau 60,5%. Secara parsial (uji-t) menunjukkan hasil yaitu Variabel pendapatan rill (X1), inflasi (X2) dan suku bunga (X3) berpengaruh secara positif dan signifikan terhadap nilai tukar dengan nilai t-hitung pendapatan rill (3,924) > t-tabel (2,052) dengan tingkat sig (0,003) < (0,05), variabel inflasi (X2) menunjukkan hasil t-hitung (4,200) > t-tabel (2,052) dengan tingkat sig (0,026) < (0,05), dan variabel suku bunga (X3) menunjukkan hasil t-hitung (4,143) > t-tabel (2,025) dengan tingkat sig (0,002) < (0,05). Secara simultan (Uji-F) antara variabel bebas (Pendapatan rill, inflasi dan suku bunga) terhadap variabel terikat (nilai tukar) menunjukkan F-hitung (7,250) > F-tabel (2,730) sehingga dapat disimpulkan bahwa variabel Bebas (pendapatan rill, inflasi dan suku bunga) secara bersama-sama berpengaruh secara signifikan terhadap variabel terikat (nilai tukar rupiah).

Kata kunci : Pendapatan rill, inflasi, suku bunga dan nilai tukar.

KATA PENGANTAR



Alhamdulillah Robbil'amin, puja dan puji syukur kehadiran Allah SWT yang telah melimpahkan rahmat, nikmat, hidayah serta inayah-Nya sehingga penulis dapat menyelesaikan tugas akhir ini. Sholawat dan salam kepada junjungan alam yakni nabi besar Muhammad SAW, dengan mengucap *Allahumma Shalli'ala Muhammad Wa'alaalihi Syaidina Muhammad*. Yang telah berjuang membawa umat manusia dari zaman kebodohan menuju zaman ilmu pengetahuan. Sehingga manusia dapat membedakan antara yang hak dan yang bathil. Semoga kita termasuk dalam generasi akhir zaman yang mendapatkan syafa'atnya diakhir kelak nanti.

Skripsi yang berjudul “ **ANALISIS FAKTOR-FAKTOR PENENTU PERUBAHAN NILAI TUKAR RUPIAH SELAMA KRISIS GLOBAL (PERIODE 2006-2013)** ” disusun guna memenuhi salah satu syarat dalam menyelesaikan pendidikan program Sarjana pada Fakultas Ekonomi dan Ilmu Sosial Universitas Islam Negeri Sultan Syarif Kasim Riau.

Pada kesempatan ini, penulis juga ingin menyampaikan ribuan terimakasih kepada semua pihak yang telah memberikan sumbangan fikiran, waktu dan tenaga serta bantuan moril dan materil khususnya kepada :

1. Secara khusus ananda ingin mengucapkan terima kasih yang sebesar-besarnya kepada Ayahanda Ismail dan Ibunda Soiyah, atas segala doa yang

telah dipanjatkan, serta perjuangan dan pengorbanan yang tak ada hentinya untuk ananda sehingga ananda bisa menyelesaikan skripsi ini.

2. Bapak Prof. Dr. H. Munzir Hitami, MA, selaku Rektor Universitas Islam Negeri Sultan Syarif Kasim Riau.
3. Bapak DR. Mahendra Romus, SP, M.ec, selaku Dekan Fakultas Ekonomi dan Ilmu Sosial Universitas Islam Negeri Sultan Syarif Kasim Riau.
4. Bapak Mulya Sosiady, SE, MM, AK, dan Ibu Irien Violinda Anggriani, SE, M.Si selaku ketua dan sekretaris Jurusan Manajemen Fakultas Ekonomi dan Ilmu Sosial UIN Suska Riau.
5. Bapak Masteven, SE, Ak, selaku penasehat akademis yang selama ini telah banyak memberikan nasehat dan masukan demi kemajuan prestasi akademik penulis.
6. Ibu Umi Rachmah Damayanti, SE, MM, selaku dosen pembimbing proposal yang telah bersedia meluangkan waktu untuk membimbing dan mengarahkan dalam penulisan proposal.
7. Ibu Hariza Hasyim, SE, M.Si, selaku dosen pembimbing yang telah meluangkan waktu untuk membimbing dan mengarahkan dalam menyelesaikan skripsi ini.
8. Seluruh Bapak dan Ibu Dosen selaku staf pengajar Fakultas Ekonomi dan Ilmu Sosial Universitas Islam Negeri Sultan Syarif Kasim Riau yang telah memberikan bimbingan dan mengajarkan ilmu pengetahuan selama berkuliah.

9. Seluruh Staf Tata Usaha Fakultas Ekonomi dan Ilmu Sosial Universitas Islam Negeri Sultan Syarif Kasim Riau yang telah membantu banyak bagi penulis dalam proses administrasi selama berkuliah.
10. Buat kakak (Sulastri) dan abang-abang ku (Supri, Jarwanto, Aan) serta adik dan keponakan ku (Desi, Jamal, Ocha) yang telah memberikan semangat dan motivasi selama ini.
11. Buat teman-teman terbaikku Aditiawarman S,E, Fauzul Azmi S.E, Amsal Khairy, Imam Rahmad, Arie Fianta, Frans Julians. Kalian memang yang terbaik.
12. Buat seluruh teman-teman seperjuangan di Fakultas Ekonomi khususnya Manajemen Lokal D'10 dan Manajemen Keuangan lokal A'10 (Ari Darmawan, Rian Fadillah, alm. M. Gery Rizki, Timbul Wicaksono SE, Al-hafiz, Kiki, Yamin, Dwi Susilowati, S.E, Jessi Sosesaji, S.E dan semua teman-teman lainnya yang tidak bisa saya sebutkan satu-persatu) yang telah banyak memberikan semangat dan motivasi, serta untuk keceriaan yang kalian berikan.
13. Buat Sri Wahyuni, S.Pdi yang telah memberikan semangat dan motivasi serta perhatian yang tak terhingga.

Penulis menyadari bahwa dalam penyusunan skripsi ini masih jauh dari kesempurnaan. Oleh karena itu saran dan kritikan yang sifatnya membangun sangat diharapkan.

Pekanbaru, September 2014

Penulis

EDI GUNAWAN

DAFTAR ISI

ABSTRAK	i
KATA PENGANTAR	ii
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	viii
DAFTAR GAMBAR	ix
BAB I : PENDAHULUAN	
I.1. Latar belakang masalah	1
I.2. Perumusan masalah.....	7
I.3. Tujuan penelitian	7
I.4. Manfaat penelitian.....	8
I.5. Sistematika Penulisan.	9
BAB II : TINJAUAN PUSTAKA	
II.1. Uang dan permintaan uang.....	11
II.1.1. Sejarah uang	11
II.1.2. Jenis-jenis uang	12
II.1.2.1. Uang barang (<i>commodity money</i>).....	13
II.1.2.2. Uang tanda/kertas (<i>token money</i>).	13
II.1.2.3. Uang giral	14
II.1.3. Uang dalam pandangan islam.....	15
II.1.4. Fungsi uang	18
II.2. Pendapatan riil	19
II.3. Inflasi	20
II.3.1. Jenis-jenis inflasi	23
II.3.2. Kebijakan penanggulangan inflasi	25
II.4. Suku bunga.	27
II.4.1. Suku bunga SBI	29
II.5. Nilai tukar	30
II.5.1 Sistem nilai tukar	36
II.5.2 Nilai tukar dalam pandangan islam.	39
II.6. Penelitian terdahulu.	48
II.7. Kerangka konseptual	51
II.8. Hipotesis penelitian	52
BAB III : METODE PENELITIAN	
III.1. Lokasi penelitian	53
III.2. Jenis dan sumber data.	53
III.3. Teknik analisis data.....	54
III.3.1. Analisis Regresi Berganda.	54
III.3.2. <i>Simultan Test</i> (Uji F).....	54
III.3.3. Partial Test (Uji T)	55
III.4. Uji Asumsi Klasik.....	55
III.4.1. Uji Normalitas data.	56

III.4.2. Uji Multikolinearitas	56
III.4.3. Uji Heteroskedastisitas.....	57
III.4.4. Uji Autokorelasi.....	57
III.5. Koefisien Determinasi (R^2).....	58
BAB IV : SEJARAH NEGARA INDONESIA DAN GAMBARAN PEREKONOMINAN INDONESIA	
IV.1. Sejarah negara Indonesia	60
IV.1.1. Letak astronomis, geografis dan geologis Indonesia	61
IV.1.1.1. Letak astronomis Indonesia.	61
IV.1.1.2. Letak geografis Indonesia.....	62
IV.1.1.3. Letak geologis Indonesia	62
IV.2. Gambaran umum perekonomian Indonesia	64
IV.2.1. Periode tahun 2006	65
IV.2.2. Periode tahun 2007	66
IV.2.3. Periode tahun 2008	67
IV.2.4. Periode tahun 2009.	69
IV.2.5. Periode tahun 2010.	71
IV.2.6. Periode tahun 2011.	73
IV.2.7. Periode tahun 2012.	76
IV.2.8. Periode tahun 2013.	78
BAB V : HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
V.1. Analisis Regresi Linear Berganda.....	84
V.1.1. Uji Signifikansi Parsial (Uji T).	88
V.1.2. Uji Signifikansi Simultan (Uji F).....	90
V.1.3. Koefisien Determinasi (R^2)	91
V.2. Uji Asumsi Klasik.	93
V.2.1. Uji Normalitas.....	93
V.2.2. Uji Multikolinearitas	95
V.2.3. Uji Autokorelasi	97
V.2.4. Uji Heteroskedastisitas.....	98
BAB VI : KESIMPULAN DAN SARAN	
VI.1. Kesimpulan.	100
VI.2. Saran	101

DAFTAR PUSTAKA
LAMPIRAN

DAFTAR TABEL

Tabel		Hal
Tabel I.1	: Indikator Makroekonomi Indonesia 2006-2013	4
Tabel IV.1	: Neraca Pembayaran Indonesia 2006-2013	64
Tabel V.1	: Output Regresi dengan program SPSS versi 16.0.	85
Tabel V.2	: Output Regresi Linear Berganda dengan program SPSS versi 16.0.....	86
Tabel V.3	: Output Uji T dengan menggunakan program SPSS versi 16.0.....	88
Tabel V.4	: Output Uji F dengan program SPSS versi 16.0	90
Tabel V.5	: Outpt Uji Koefisien Determinasi dengan program SPSS versi 16.0.....	92
Tabel V.6	: Output Uji Multikolinearitas dengan <i>Variance Inflation Factor (VIF)</i> menggunakan program SPPS versi 16.0	96
Tabel V.7	: Output Uji Autokorelasi Durbin Watson dengan program SPSS versi 16.0	97

DAFTAR GAMBAR

Gambar	Hal
Gambar II.1. : Kerangka Konseptual Analisis Faktor-faktor Penentu Perubahan Nilai Tukar Rupiah.....	51
Gambar V.1 : Output Uji Normalitas dengan histogram menggunakan program SPSS versi 16.0	94
Gambar V.2. : Output Uji Normalitas <i>Normal P-Plot of Regression Standarized Residual</i> dengan program SPSS versi 16.0....	95
Gambar V.3. : Output Uji Heteroskedastisitas dengan program SPSS versi 16.0.....	98