

## DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERNYATAAN .....	ii
KATA PENGANTAR .....	iii
DAFTAR ISI.....	v
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR LAMPIRAN.....	ix
INTISARI.....	x
ABTRACT .....	xi
BAB I PENDAHULUAN .....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	4
1.3 Pertanyaan Penelitian.....	5
1.4 Tujuan Penelitian .....	5
1.5 Manfaat Penelitian .....	6
1.6 Ruang Lingkup Penelitian .....	6
1.7 Sistematika Penelitain.....	6
BAB II LANDASAN TEORI .....	9
2.1 Gambaran Umum Nilai Tukar .....	9
2.2 Pengertian Nilai Tukar.....	10
2.3 Sistem Nilai Tukar.....	11
2.4 Paritas Daya Beli ( <i>Purchasing Power Parity</i> ).....	12
2.4.1 <i>The Law Of One Price</i> .....	13
2.4.2 Paritas Daya Beli Absolut .....	13

2.4.3 Paritas Daya Beli Relatif .....	15
2.5 Inflasi .....	16
2.5.1 Macam-macam Inflasi .....	17
2.6 Penelitian Terdahulu .....	18
2.7 Pengembangan Hipotesis.....	19
2.8.1 Hubungan Perubahan Inflasi dan Kurs Rupiah Terhadap Dollar Amerika.....	19
<b>BAB III METODE PENELITIAN.....</b>	<b>21</b>
3.1 Data Penelitian.....	21
3.1.1 Jenis dan Sumber Data .....	21
3.2 Definisi Operasional .....	22
3.2.1 Nilai Tukar.....	22
3.2.2 Perbedaan Tingkat Inflasi .....	22
3.2.3 Perbedaan <i>Gross Domestic Product</i> .....	23
3.3 Metode Analisis Data .....	24
3.3.1 Uji Stasioner ( <i>Unit Root Test</i> ) .....	24
3.3.2 Penentuan Lag Optimal .....	26
3.3.3 Vector Autoregression (VAR).....	27
3.3.4 Pairwise Granger Causality .....	28
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN .....</b>	<b>31</b>
4.1 Uji Stasioner ( <i>Unit Root Test</i> ) .....	31
4.2 Penentuan <i>Lag Optimal</i> .....	34
4.3 <i>Vector Autoregression</i> .....	35
4.4 <i>Pairwise Granger Causality</i> .....	39
4.6 Pembahasan Uji Hipotesis .....	40

4.5.1 Hubungan Perubahan Inflasi Terhadap Kurs	
Rupiah/Dollar .....	40
4.5.2 Hubungan Perubahan GDP Terhadap Kurs	
Rupiah/Dollar .....	41
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	43
5.1 Kesimpulan.....	43
5.2 Keterbatasan Penelitian .....	43
5.3 Saran .....	44
DAFTAR PUSTAKA .....	45
LAMPIRAN.....	47

## DAFTAR TABEL

		Halaman
Tabel 4.1	Hasil Pengujian <i>Augmented Dickey Fuller</i> , Kurs pada Tingkat Level	32
Tabel 4.2	Hasil Pengujian <i>Augmented Dickey Fuller</i> , Perbedaan Tingkat Inflasi pada Tingkat Level	32
Tabel 4.3	Hasil Pengujian <i>Augmented Dickey Fuller</i> , Perbedaan <i>Gross Domestic Product</i> pada Tingkat dan 1 <sup>st</sup> <i>Difference</i>	33
Tabel 4.4	Hasil Pengujian Penentuan Panjang Lag Optimal	34
Tabel 4.5	Hasil Pengujian Vector Autoregression Variabel Kurs	36
Tabel 4.6	Hasil Pengujian Vector Autoregression Variabel Perbedaan Inflasi	37
Tabel 4.7	Hasil Pengujian Vector Autoregression Variabel Perbedaan Gross Domestic Product	38
Tabel 4.8	Hasil Pengujian Pairwise Granger Causality	39

## DAFTAR LAMPIRAN

		Halaman
Lampiran 1	Uji Unit Root Test Variabel Kurs Tingkat Level (Intercept)	48
Lampiran 2	Uji Unit Root Test Variabel Kurs Tingkat Level (Intercept & Trend)	49
Lampiran 3	Uji Unit Root Test Variabel Inflasi Tingkat Level (Intercept)	50
Lampiran 4	Uji Unit Root Test Variabel Inflasi Tingkat Level (Intercept & Trend)	51
Lampiran 5	Uji Unit Root Test Variabel Gross Domestic Product Tingkat Level (Intercept)	52
Lampiran 6	Uji Unit Root Test Variabel Gross Domestic Product Tingkat Level (Intercept & Trend)	53
Lampiran 7	Uji Unit Root Test Variabel Gross Domestic Product Tingkat 1 <sup>st</sup> Difference (Intercept)	54
Lampiran 8	Uji Unit Root Test Variabel Gross Domestic Product Tingkat 1 <sup>st</sup> Difference (Intercept & Trend)	55
Lampiran 9	Uji Lag Optimal	56
Lampiran 10	Vector Autoregressive	57
Lampiran 11	Koefisien Regresi Kurs	59
Lampiran 12	Koefisien Regresi Inflasi	60
Lampiran 13	Koefisien Regresi Gross Domestic Product	61
Lampiran 14	Uji Pairwise Granger Causality	62