

**ANALISIS PENGARUH *GROSS DOMESTIC PRODUCT*, JUMLAH UANG
BEREDAR, NILAI TUKAR DAN PENGANGGURAN TERHADAP
INFLASI DI INDONESIA TAHUN 1991-2014**



Skripsi

Diajukan untuk Melengkapi Syarat-Syarat

Untuk Mencapai Gelar Sarjana Ekonomi Jurusan Ekonomi Pembangunan

Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Sebelas Maret Surakarta

Oleh :

RISKI AGUNG PRASETIYO

F0112084

FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS

UNIVERSITAS SEBELAS MARET

SURAKARTA

2017

ABSTRAK

ANALISIS PENGARUH GROSS DOMESTIC PRODUCT, JUMLAH UANG BEREDAR, NILAI TUKAR, DAN PENGANGGURAN TERHADAP INFLASI DI INDONESIA TAHUN 1991-2014

RISKI AGUNG PRASETIYO

F0112084

Inflasi merupakan permasalahan yang timbul pada perekonomian di seluruh dunia termasuk di Indonesia. Munculnya inflasi itu sendiri dipengaruhi dan mempengaruhi bidang lain. Penelitian ini dilakukan untuk melihat apakah benar *gross domestic product*, jumlah uang beredar, nilai tukar, dan pengangguran mempengaruhi inflasi atau terjadi sebaliknya. Data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data sekunder tahunan yang diperoleh dari World Bank dengan periode data tahun 1991 sampai 2014. Metode yang digunakan adalah metode analisis linier berganda dengan kointegrasi, uji kausalitas Granger dan uji hipotesis yang terdiri dari uji F, uji t dan uji R².

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa secara parsial *gross domestic product* memiliki pengaruh positif signifikan terhadap inflasi. Jumlah uang beredar berpengaruh negatif signifikan terhadap inflasi. Nilai tukar berpengaruh positif signifikan terhadap inflasi. Pengangguran berpengaruh negatif signifikan terhadap inflasi. Secara simultan, *gross domestic product*, jumlah uang beredar, nilai tukar dan pengangguran berpengaruh signifikan terhadap inflasi. Arah kausalitas yang terjadi adalah satu arah dari *gross domestic product* menuju inflasi. Kausalitas satu arah juga terjadi dari inflasi menuju ke jumlah uang beredar. Nilai tukar dan inflasi memiliki kausalitas dua arah. Kausalitas satu arah terjadi dari Inflasi menuju ke pengangguran.

Kata Kunci : *gross domestic product*, jumlah uang beredar, nilai tukar, pengangguran, inflasi, kausalitas granger

ABSTRACT

AN ANALYSIS IMPACT OF GROSS DOMESTIC PRODUCT, BROAD MONEY, EXCHANGE RATE, AND UNEMPLOYMENT TO INFLATION IN INDONESIA PERIOD 1991-2014

RISKI AGUNG PRASETIYO

F0112084

In every country in the world included Indonesia, inflation is a problem that appear in the economic.the appearing of inflation affect and affected by another sector. The purpose of this research is for observe the truth either gross domestic product, broad money, exchange rate, and unemployment influence the inflation or the other way. This research use annual secondary data on period 1991 to 2014 from World Bank. The method this research used are multiple linear regression analysis with cointegration, Granger-Causality, and hypothesis test that include F-test, t-test, and R-squared test.

The result showed that partially, gross domestic product has affect significantly positive toward inflation. Broad money has affect significantly negative toward inflation. Exchange rate affect significantly positive toward inflation. Unemployment affect significantly negative toward inflation. Simultaneously, gross domestic product, broad money, exchange rate, and unemployment significantly affect the inflation. Unidirectional causality from gross domestic product to inflation. Unidirectional causality from inflation to broad money. Bidirectional causality from exchange rate and inflation. Unidirectional causality from inflation to unemployment.

Keyword : gross domestic product, broad money, exchange rate, unemployment, inflation, granger causality

HALAMAN PERSETUJUAN PEMBIMBING

Skripsi

**ANALISIS PENGARUH GROSS DOMESTIC PRODUCT, JUMLAH
UANG BEREDAR, NILAI TUKAR, DAN PENGANGGURAN TERHADAP
INFLASI DI INDONESIA TAHUN 1991-2014**

Diajukan Oleh:

Riski Agung Prasetyo

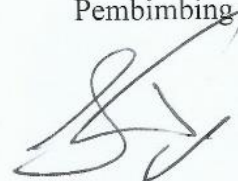
NIM: F0112084

Telah disetujui dan diterima oleh pembimbing pada tanggal

28 November 2016

Surakarta, 28 November 2016

Pembimbing



Drs. Sutanto, M.Si

NIP.195611291986011001

HALAMAN PENGESAHAN

Skripsi

**ANALISIS PENGARUH GROSS DOMESTIC PRODUCT, JUMLAH UANG BEREDAR,
NILAI TUKAR, DAN PENGANGGURAN TERHADAP INFLASI DI INDONESIA
TAHUN 1991-2014**

Diajukan Oleh:

Riski Agung Prasetyo

NIM: F0112084

Telah dipertahankan di depan Tim Penguji Skripsi Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas
Sebelas Maret Surakarta

Pada tanggal 16 Januari 2017

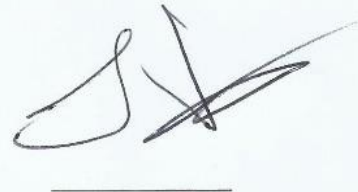
Ketua : **Drs. Kresno Sarosa Pribadi, M.Si**
(Penguji I) **NIP.195601181986011001**



Sekretaris : **Sumardi, S.E, M.Si**
(Penguji II) **NIP.196209081987021004**



Pembimbing : **Drs. Sutanto M,Si**
(Penguji III) **NIP.195611291986011001**



SURAT PERNYATAAN

Yang bertanda tangan di bawah ini mahasiswa Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Sebelas Maret :

Nama : Riski Agung P
NIM. : F0112084
Program Studi : Ekonomi Pembangunan
Judul Skripsi : Analisis Pengaruh Gross Domestic Product, Jumlah Uang Beredar, Nilai Tukar, dan Pengangguran terhadap Inflasi di Indonesia tahun 1991-2014

Menyatakan dengan sebenarnya, bahwa Skripsi yang saya buat ini adalah benar-benar merupakan hasil karya sendiri dan bukan merupakan hasil jiplakan/salinan/sanduran dari karya orang lain.

Apabila ternyata dikemudian hari terbukti pernyataan ini tidak benar, maka saya bersedia menerima sanksi akademik berupa penarikan Ijazah dan pencabutan gelar sarjananya.

Demikian pernyataan ini saya buat dengan sebenar-benarnya.



Surakarta, 28 November 2016

Mahasiswa

Riski Agung P
NIM. F0112084

HALAMAN MOTTO

“Janganlah kamu bersikap lemah, dan janganlah pula kamu bersedih hati, padahal kamulah orang-orang yang paling tinggi derajatnya, jika kamu orang-orang yang beriman.” (Q.S. Al-Imran: 139)

“Janganlah kamu bersikap lemah, dan janganlah pula kamu bersedih hati, padahal kamulah orang-orang yang paling tinggi derajatnya, jika kamu orang-orang yang beriman.” (Q.S. Al-Imran: 139)

“Make the world revolve around you. It’s more fun to think that way”
(Tendou Souji – Kamen Rider Kabuto)

“Maybe the future is bad. But there's a future beyond that, right?”
(Yuno Gasai – Mirai Nikki)

"I won't lose to anyone! Only I can defeat my own self!
I'll keep being an idiot till the end"
(Eze - Brave Frontier)

“For my little sister’s sake, I will do everything that necessary”
(Penulis)

HALAMAN PERSEMBAHAN

“For my beloved mother and sister”

KATA PENGANTAR

Puji syukur kami panjatkan kehadiran Allah SWT yang senantiasa memberikan rahmat dan hidayah-Nya sehingga penulis dapat menyelesaikan penulisan skripsi ini yang berjudul “**Analisis Pengaruh *Gross Domestic Product*, Jumlah Uang Beredar, Nilai Tukar, dan Pengangguran terhadap Inflasi di Indonesia tahun 1991-2014**” dengan baik. Skripsi ini disusun untuk memenuhi syarat demi mencapai gelar Sarjana Ekonomi Jurusan Ekonomi Pembangunan Fakultas Ekonomi dan Bisnis (FEB) Universitas Sebelas Maret (UNS) Surakarta.

Penulis menyadari dalam penulisan skripsi ini mendapatkan bermacam-macam bantuan dari berbagai pihak. Oleh karena itu, penulis menyampaikan banyak terima kasih kepada :

1. Dr. Hunik Sri Runing S, M.Si. selaku Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Sebelas Maret Surakarta.
2. Dr. Siti Aisyah Tri Rahayu, S.E., M.Si. selaku Ketua Jurusan Ekonomi Pembangunan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Sebelas Maret Surakarta yang telah memberikan ilmunya kepada peneliti sehingga penelitian ini dapat terwujud.
3. Drs. Sutanto, M.Si. selaku Pembimbing Akademik dan dosen pembimbing skripsi yang telah meluangkan banyak waktunya untuk membimbing dan memberikan pengarahan serta ilmunya kepada penulis dari awal hingga akhir penulisan.
4. Vita Kartika Sari, S.E., M.Sc. selaku dosen pembimbing magang yang telah memberikan banyak bantuan dalam kegiatan kuliah magang kerja

5. Seluruh dosen FEB UNS, terutama dosen-dosen Ekonomi Pembangunan yang telah membuka wawasan penulis dengan ilmu yang diberikan, dan juga kepada seluruh staff FEB UNS yang membantu penulis dalam mengurus berbagai keperluan administrasi.
6. Kedua orang tua penulis yang sudah berjuang mati-matian membesarkan dan mendidik penulis dari kecil, Semoga Allah SWT selalu memberikan kesehatan dan kekuatan kepada kedua orang tua penulis serta keselamatan di dunia maupun akhirat.
7. Saudari penulis Intan Ayu Permatasari, adik perempuan yang sangat berarti bagi penulis.
8. Sahabat karib penulis Hamas Fajar Hidayatullah dan Heri Susanto yang selalu membantu penulis dan ada di saat penulis senang maupun susah.
9. Sahabat-sahabat seperjuangan tingkat akhir, sahabat Selasa Hore, sahabat magang penulis, dan teman seperjuangan satu bimbingan, Hamas Fajar H, Rido Roiyan M, M Harrits, Theofanius B M Sinurat, Budi Jati Prakoso, dan Dina Fajar.
10. Sahabat Kos yang selalu mencerikan suasana dan menemani penulis, Heri Susanto, Rido Roiyan, Anang Bachtiar, Alifi Risqi, Bashari, Rizal, Agus, Resha, Pandi Tole, Indra WNI.
11. Sahabat yang selalu menghibur penulis ketika pulang kampung, Maldhimas U W, Andriyan Yoga P, Faikar A, M Ivan AS, Wildan Akbar, Wildan Nur Fajri, Wildan M, Abdulah Raihan, Rifqi Ryan, Dzulfikar Ali, Noval Aji P, Daniel Yudha. Terima kasih atas bantuan

dan dukungannya selama ini semoga masih bisa berkumpul hingga tua nanti.

12. Rurin Luswidya Artaty Umar, Oktavian Dita Ratnasari, dan Arifiana Ufah, yang telah mengisi dan memberikan kenangan di kehidupan penulis sehingga penulis bisa semaju sekarang ini. Terima kasih, aku tak akan melupakan kalian.
13. Keluarga KKN Cabeyan Periode Juli-Agustus 2015 yang telah memberikan pengalaman hidup yang tak tergantikan selama satu setengah bulan tinggal dan hidup bersama.
14. Teman-teman S1 Ekonomi Pembangunan FEB UNS angkatan 2012 yang sudah bersedia menjadi teman seperjuangan dari awal kuliah hingga lulus.
15. Pihak-pihak lain yang tak dapat disebutkan satu-persatu yang telah membantu dalam penyelesaian penulisan skripsi ini.

Akhir kata, penulis berusaha semaksimal mungkin dalam penyusunan skripsi ini, namun demikian pasti terdapat kekurangan yang ada pada skripsi ini. Penulis mengharapkan kritik dan saran yang bersifat membangun untuk menyempurnakan skripsi ini. Harapan penulis adalah skripsi ini bisa bermanfaat bagi para pembacanya.

Surakarta, November 2016

Penulis

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
ABSTRAK	ii
ABSTRACT	iii
HALAMAN PERSETUJUAN PEMBIMBING	iv
HALAMAN PENGESAHAN	v
HALAMAN PERNYATAAN SKRIPSI	vi
HALAMAN MOTTO	vii
HALAMAN PERSEMBAHAN	viii
KATA PENGANTAR	ix
DAFTAR ISI	xii
DAFTAR TABEL	xvi
DAFTAR LAMPIRAN	xviii
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang	1
B. Perumusan Masalah	6
C. Tujuan Penelitian	7
D. Manfaat Penelitian	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	9
A. Landasan Teori	9
1. Inflasi	9
2. <i>Gross Domestic Product</i>	11
3. Jumlah Uang Beredar	15

4. Nilai Tukar	18
5. Pengangguran	19
6. Variabel yang memengaruhi Inflasi	20
a. <i>Gross Domestic Product</i> terhadap inflasi	20
b. Jumlah uang beredar terhadap inflasi	22
c. Nilai Tukar terhadap inflasi	23
d. Pengangguran terhadap inflasi	25
B. Penelitian Terdahulu	26
C. Kerangka Pemikiran	30
D. Hipotesis	34
BAB III METODE PENELITIAN	36
A. Ruang Lingkup Penelitian	36
B. Jenis dan Sumber Data	36
C. Devinisi Operasional Variabel	36
1. Variabel Dependen	36
2. Variabel Independen	37
D. Teknik Analisis Data	37
1. Pemilihan Model	38
2. Uji Akar Unit	39
3. Uji Derajat Integrasi	40
4. Uji Kointegrasi	40
5. Regresi OLS	42
6. Kausalitas Granger	43
Uji Asumsi Klasik	45

1. Uji Multikolinieritas	45
2. Uji Normalitas	45
3. Uji Homoskedastisitas	46
4. Uji Auto Korelasi	46
Uji Statistik	47
1. Uji Signifikansi Simultan	47
2. Uji Koefisien Determinasi	48
3. Uji Signifikansi Parameter Individual	48
 BAB IV PEMBAHASAN	 50
A. Gambaran Umum Objek Penelitian	50
1. Inflasi	50
2. Gross Domestic Product	52
3. Jumlah Uang Beredar	54
4. Nilai Tukar	56
5. Pengangguran	58
B. Hasil Analisis Data	60
1. Pemilihan Model	60
2. Uji Akar Unit	61
3. Uji Derajat Integrasi	63
4. Uji Kointegrasi	66
5. Regresi OLS	68
6. Kausalitas Granger	69
Uji Asumsi Klasik	72
1. Uji Multikolinieritas	72

2. Uji Normalitas	73
3. Uji Heteroskedastisitas	74
4. Uji Auto Korelasi	74
Uji Statistik	75
1. Uji Signifikansi Simultan (uji F)	76
2. Uji Koefisien Determinasi	76
3. Uji Signifikansi Parameter Individual (uji-t)	76
C. Pembahasan	78
1. Pengaruh Gross Domestic Product terhadap inflasi.....	79
2. Pengaruh Jumlah Uang Beredar terhadap inflasi	80
3. Pengaruh Nilai Tukar terhadap inflasi	81
4. Pengaruh Pengangguran terhadap inflasi	83
5. Arah Hubungan Kausalitas	84
 BAB V PENUTUP	 85
A. Kesimpulan	85
B. Keterbatasan	87
C. Saran	87
 DAFTAR PUSTAKA	 89
 LAMPIRAN	

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Data Pertumbuhan Ekonomi dan Inflasi Indonesia tahun 2009-2014.....	3
Tabel 4.1 Data Inflasi Indonesia tahun 1991-2014	51
Tabel 4.2 Data GDP Indonesia tahun 1991-2014	53
Tabel 4.3 Data JUB Indonesia tahun 1991-2014	55
Tabel 4.4 Data Nilai Tukar Indonesia tahun 1991-2014	57
Tabel 4.5 Data Pengangguran Indonesia tahun 1991-2014	59
Tabel 4.6 Hasil uji MWD	60
Tabel 4.7 Hasil uji akar unit Inflasi	61
Tabel 4.8 Hasil uji akar unit LGDP	61
Tabel 4.9 Hasil uji akar unit LJUB	62
Tabel 4.10 Hasil uji akar unit LNT	62
Tabel 4.11 Hasil uji akar unit TP	63
Tabel 4.12 Hasil uji derajat integrasi Inflasi	63
Tabel 4.13 Hasil uji derajat integrasi LGDP.....	64
Tabel 4.14 Hasil uji derajat integrasi LJUB	64
Tabel 4.15 Hasil uji derajat integrasi LNT	65
Tabel 4.16 Hasil uji derajat integrasi TP	65

Tabel 4.17 Hasil uji Akar unit residual	66
Tabel 4.18 Hasil Uji Kointegrasi Johansen Trace Statistic	67
Tabel 4.19 Hasil Uji Kointegrasi Johansen Max-Eigen Value	67
Tabel 4.20 Hasil Uji Kointegrasi Johansen	68
Tabel 4.21 Hasil Uji Regresi	68
Tabel 4.22 Hasil Penentuan Panjang Lag	69
Tabel 4.23 Hasil Uji Kausalitas Granger	70
Tabel 4.24 Hasil Perbandingan Nilai <i>Adjusted R-squared</i>	72
Tabel 4.25 Hasil uji LM ARCH	74
Tabel 4.26 Hasil Uji Autokorelasi	75
Tabel 4.27 Hasil Regresi terhadap Model Log Linier Jangka Panjang	75
Tabel 4.28 Hasil Uji-t terhadap Nilai t-tabel	76
Tabel 4.29 Hasil Kointegrasi Jangka Panjang	78
Tabel 4.30 Hasil Regresi Model Jangka Panjang	78
Tabel 4.31 Hasil Kausalitas Granger	79

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran	30
Gambar 4.1 Gambaran Perkembangan Inflasi tahun 1991-2014	50
Gambar 4.2 Gambaran Perkembangan GDP tahun 1991-2014	52
Gambar 4.3 Gambaran Perkembangan JUB tahun 1991-2014	54
Gambar 4.4 Gambaran Perkembangan nilai tukar tahun 1991-2014	56
Gambaran 4.5 Gambaran Perkembangan tingkat pengangguran tahun 1991-2014..	58
Gambar 4.6 Hasil Uji Normalitas Model Log Linier Jangka Panjang	73