

 PERPUSTAKAAN	MILIK PERPUSTAKAAN UNIVERSITAS ATMA JAYA YOGYAKARTA	
	Diterima	26 MAR 2008
	Inventarisasi	: 294/IE/Hd.03/2008
	Klasifikasi	: RJ 332.1 Win 08
	Subyek	: Inflation.

 PERPUSTAKAAN	UNIVERSITAS ATMA JAYA YOGYAKARTA FAKULTAS EKONOMI Program Studi Ilmu Ekonomi
---	--

Kausalitas Tingkat Suku Bunga dengan Tingkat Inflasi

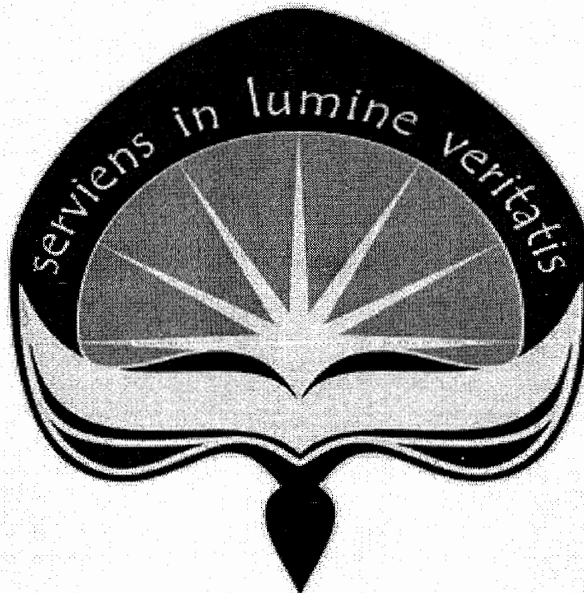
Studi Kasus di Indonesia Periode Tahun 2003-2006

SKRIPSI

Untuk Memenuhi Sebagian Persyaratan Mencapai Derajat Sarjana Ekonomi (S1)

Pada Program Studi Ilmu Ekonomi

Fakultas Ekonomi Universitas Atma Jaya Yogyakarta



Disusun oleh :

Perpetua Windhy Harmonie

NPM : 03 11 14330

**FAKULTAS EKONOMI
UNIVERSITAS ATMA JAYA
YOGYAKARTA**

2008

Kausalitas Tingkat Suku Bunga dengan Tingkat Inflasi

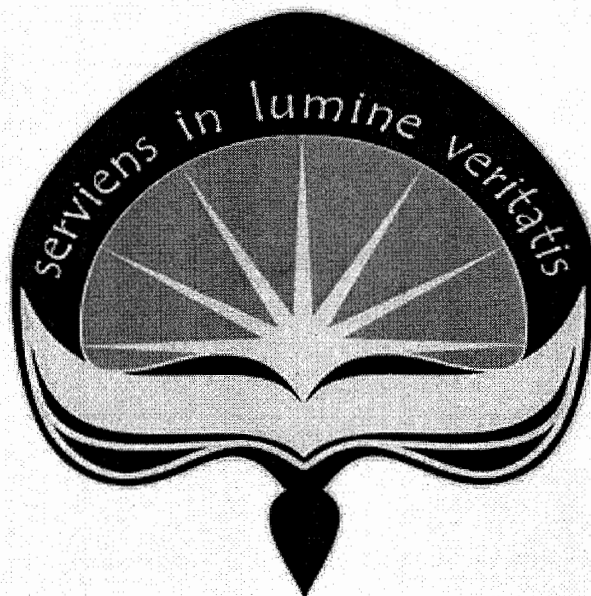
Studi Kasus di Indonesia Periode Tahun 2003-2006

SKRIPSI

Untuk Memenuhi Sebagian Persyaratan Mencapai Derajat Sarjana Ekonomi (S1)

Pada Program Studi Ilmu Ekonomi

Fakultas Ekonomi Universitas Atma Jaya Yogyakarta



Disusun oleh :

Perpetua Windhy Harmonie

NPM : 03 11 14330

**FAKULTAS EKONOMI
UNIVERSITAS ATMA JAYA
YOGYAKARTA**

2008

SKRIPSI
KAUSALITAS TINGKAT SUKU BUNGA DENGAN TINGKAT
INFLASI STUDI KASUS DI INDONESIA
PERIODE TAHUN 2003-2006

Disusun Oleh :

Perpetua Windhy Harmonie

NPM : 03 11 14330

Telah dibaca dan disetujui oleh :

Pembimbing Utama

Kuspradono

Kuspradono, Dipl-Volksw.

Tanggal, 11 Februari 2008

SKRIPSI

KAUSALITAS TINGKAT SUKU BUNGA DENGAN TINGKAT INFLASI STUDI KASUS DI INDONESIA PERIODE TAHUN 2003-2006

Yang dipersiapkan dan disusun oleh :

Perpetua Windhy Harmonie

NPM : 03 11 14330

**Telah dipertahankan di depan panitia penguji pada tanggal 6 Maret 2008
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

Kuspradono

Kuspradono, Dipl.Volksw

Anggota

A. Gunadi Brata

A. Gunadi Brata, SE.Msi

Yenny Patnasari

Yenny Patnasari, SE.Msi

Yogyakarta, 6 Maret 2008

Dekan Fakultas Ekonomi

Universitas Atma Jaya Yogyakarta


Dr. R. Maryatmo, MA.
FAKULTAS
EKONOMI

PERNYATAAN

Saya yang bertanda tangan di bawah ini dengan sesungguhnya menyatakan bahwa skripsi dengan judul :

**KAUSALITAS TINGKAT SUKU BUNGA DENGAN TINGKAT INFLASI
STUDI KASUS DI INDONESIA PERIODE TAHUN 2003-2006**

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 saya akan mengembalikan kepada Universitas Atma Jaya Yogyakarta.

Yogyakarta, 11 Februari 2008

Yang menyatakan,



Perpetua Windhy Harmonie

KATA PENGANTAR

Puji dan syukur penulis panjatkan kepada Bapa di Surga, Tuhan Yesus Kristus dan Bunda Maria atas berkat, kasih dan bimbingan-Nya sehingga penulis dapat menyelesaikan penulisan skripsi yang berjudul KAUSALITAS TINGKAT SUKU BUNGA DENGAN TINGKAT INFLASI STUDI KASUS DI INDONESIA PERIODE TAHUN 2003-2006.

Tujuan dari penulisan skripsi ini adalah untuk memenuhi salah satu syarat mencapai derajat sarjana S-1 pada Fakultas Ekonomi Program Studi Ilmu Ekonomi di Universitas Atma Jaya Yogyakarta.

Penulis Menyadari bahwa penulisan skripsi ini masih jauh dari sempurna karena terbatasnya kemampuan penulis. Oleh karena itu penulis mengharapkan kritik dan saran demi sempurnanya tulisan ini.

Pada kesempatan ini penulis ingin menyampaikan ucapan terima kasih yang sebesar-besarnya atas segala bantuan, bimbingan dan dukungan yang telah diberikan dengan tulus kepada penulis sampai terselesaikan skripsi ini kepada :

1. Bapa di Surga, Tuhan Yesus Kristus dan Bunda Maria atas berkat, kasih dan bimbingan-Nya
2. Bapak R. Maryatmo, Dr.,MA. selaku Dekan Fakultas Ekonomi Universitas Atma Jaya Yogyakarta
3. Ibu AM. Rini Setyastuti, SE., M.Si. selaku ketua Program Studi Ilmu Ekonomi Fakultas Ekonomi Universitas Atma Jaya Yogyakarta. Terima kasih atas segala dukungan dan nasehatnya

4. Bapak Kuspradono, Dipl-Volksw. selaku Dosem Pembimbing Utama yang telah mengorbankan waktu, memberikan sumbangan pemikiran dan pengarahan dalam penulisan skripsi ini sampai selesai
5. Mama, Bapak dan Dek Odie atas segala doa, restu dan dukungan baik secara material maupun semangat dalam menyelesaikan studi S-1 di Fakultas Ekonomi Universitas Atma Jaya Yogyakarta
6. Simbah Soegiharto dan Simbah Somo kakung putri atas segala doa dan restunya
7. Semua dosen, karyawan TU dan karyawan perpustakaan S1 Universitas Atma Jaya Yogyakarta yang telah membantu penulis dalam menyusun skripsi ini
8. Siztah Aurel dan Jeng En En atas segala bantuan dan dukungannya
9. Teman-teman yang bersama-sama dalam menyelesaikan skripsi : Eko, Leo, Yuni, Ika, Cici, Yudi, Endang, Mas Bayu, dan Yayan. Terima kasih atas segala bantuannya
10. Teman-teman KKN Kelompok 16 Padukuhan Dondong : Vina, Sabet, Robert dan Narren. Terima kasih atas dukungan dan kebersamaannya
11. Teman-teman di kost Indraprasta 253 : Nene, Mbak Dian, Mbak Upay dan Mbak Ari. Terima kasih atas dukungan, nasehat dan kebersamaannya, luv u friends
12. Om Priyo dan Mbak Niken atas segala fasilitasnya
13. Chandra yang telah memberikan dukungan setulusnya, makasi ya chan

14. Semua orang yang tidak dapat penulis sebutkan satu persatu yang telah sangat membantu penulis dalam menyusun skripsi ini.

Akhir kata penulis mengucapkan banyak terima kasih yang sebesar-besarnya kepada para pembaca. Semoga skripsi ini dapat bermanfaat bagi semua pihak.

Yogyakarta, 11 Februari 2008



Perpetua Windhy Harmonie

Skripsi ini saya persembahkan untuk..

Bapak, Mama dan adek Odie tercinta

Thank you very much..



DAFTAR ISI

Halaman Judul	i
Halaman Persetujuan Pembimbing	ii
Halaman Pengesahan Skripsi	iii
Halaman Pernyataan	iv
Kata Pengantar	v
Halaman Persembahan	viii
Daftar Isi	ix
Intisari	xi
 BAB I PENDAHULUAN	 1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Tujuan Penelitian	6
1.4 Manfaat Penelitian	6
1.5 Studi Terkait	6
1.6 Hipotesis	9
1.7 Definisi Operasional	9
1.8 Metode Penelitian	10
1.8.1 Jenis dan Sumber Data	10
1.8.2 Metode Analisis Data	10
1.8.2.1 Uji Stasioneritas	10
1.8.2.2 Uji Final Prediction Error	11
1.8.2.3 Uji Kausalitas Granger	13
1.8.2.4 Uji F	16
1.9 Sistematika Penulisan	18

BAB II LANDASAN TEORI	20
2.1 Definisi Tingkat Bunga	20
2.1.1 Teori-teori Tingkat Bunga	20
2.1.2 Macam-macam Tingkat Bunga	22
2.2 Definisi Inflasi	23
2.2.1 Teori Inflasi	23
2.2.2 Jenis-jenis Inflasi	27
2.3 Konsep Paradox Gibson	28
 BAB III GAMBARAN UMUM	 30
3.1 Gambaran Umum Tingkat Suku Bunga	30
3.2 Gambaran Umum Tingkat Inflasi	32
 BAB IV ANALISIS DATA	 36
4.1 Uji Stasioneritas Data	36
4.2 Uji <i>Final Prediction Error</i>	37
4.3 Uji Kausalitas <i>Granger</i>	41
4.4 Uji F	42
4.5 Interpretasi Ekonomi	43
 BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	 45
5.1 Kesimpulan	45
5.2 Saran	46
 DAFTAR PUSTAKA	 47

KAUSALITAS TINGKAT SUKU BUNGA DENGAN TINGKAT INFLASI STUDI KASUS DI INDONESIA PERIODE TAHUN 2003-2006

Disusun Oleh :

Perpetua Windhy Harmonie

NPM : 03 11 14330

Pembimbing

Kuspradono, Dipl.Volksw

Intisari

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui kausalitas timbal balik antara tingkat suku bunga dengan tingkat inflasi. Hipotesis dari penelitian ini adalah terdapat hubungan kausalitas timbal balik antara tingkat suku bunga dengan tingkat inflasi. Penelitian ini menggunakan metode kausalitas Granger yang dipadukan dengan metode *Final Prediction Error* (FPE) untuk menentukan panjangnya *lag* yang optimal. Berdasarkan hasil regresi uji kausalitas Granger dengan metode FPE menunjukkan bahwa terdapat hubungan kausalitas satuarah dari tingkat suku bunga ke tingkat inflasi, yaitu tingkat suku bunga mempengaruhi inflasi. Sedangkan berdasarkan perhitungan dengan metode FPE diinterpretasikan bahwa tingkat inflasi dipengaruhi oleh tingkat suku bunga pada 3 bulan sebelumnya dan dipengaruhi tingkat inflasi 1 bulan sebelumnya.

Kata kunci : tingkat suku bunga, tingkat inflasi, kausalitas Granger, *Final Prediction Error*.

