

**PENGARUH NILAI TUKAR RUPIAH DAN JUMLAH UANG
BEREDAR TERHADAP INDEKS HARGA SAHAM
OTOMOTIF DI BURSA EFEK INDONESIA
TAHUN 2010-2012**

**PUJI ASTUTI
8105097417**



**Skripsi Ini Disusun Sebagai Salah Satu Persyaratan Untuk Memperoleh
Gelar Sarjana Pendidikan Pada Fakultas Ekonomi Universitas Negeri
Jakarta**

**PROGRAM STUDI PENDIDIKAN EKONOMI
KONSENTRASI PENDIDIKAN EKONOMI KOPERASI
JURUSAN EKONOMI DAN ADMINISTRASI
FAKULTAS EKONOMI
UNIVERSITAS NEGERI JAKARTA
2013**

***THE IMPACT OF EXCHANGE RATE AND MONEY SUPPLY
ON AUTOMOTIVE STOCK PRICE INDEX
IN BURSA EFEK INDONESIA
2010-2012***

**PUJI ASTUTI
8105097417**



Skripsi is Written as Part of Bachelor Degree In Education Accomplishment

**STUDY PROGRAM OF ECONOMICS EDUCATION
CONCENTRATION IN ECONOMIC COOPERATION EDUCATION
DEPARTEMENT OF ECONOMICS AND ADMINISTRATION
FACULTY OF ECONOMICS
STATE UNIVERSITY OF JAKARTA
2013**

ABSTRAK

PUJI ASTUTI. “Pengaruh Nilai Tukar Rupiah dan Jumlah Uang Beredar Terhadap Indeks Harga Saham Otomotif di Bursa Efek Indonesia Tahun 2010-2012”. Skripsi. Pendidikan Ekonomi Koperasi. Jurusan Ekonomi dan Administrasi. Fakultas Ekonomi. Universitas Negeri Jakarta. 2013. Dosen Pembimbing: Dr. Saparuddin, SE, M.Si dan Rd. Tuti Sariwulan, SE, M.Si.

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh nilai tukar rupiah dan jumlah uang beredar terhadap indeks harga saham otomotif di Bursa Efek Indonesia. Adapun data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data sekunder, dengan jenis data time series periode 2010-2012 dalam bulanan yang diperoleh dari *Indonesian Capital Market Electronic Library* dan Bank Indonesia. Metode penelitian menggunakan metode *ekspose facto*. Teknik analisis data yang digunakan dalam penelitian ini adalah analisis regresi berganda. Dengan menggunakan model analisis regresi berganda menggunakan software SPSS 16.0, output menunjukkan nilai tukar rupiah (X1) berpengaruh negatif dan signifikan terhadap indeks harga saham otomotif (Y) di Bursa Efek Indonesia. Dan jumlah uang beredar (X2) berpengaruh positif dan signifikan terhadap indeks harga saham otomotif (Y) di Bursa Efek Indonesia. Dari hasil Uji F dengan memperhatikan nilai signifikansinya $= 0,000 < 0,05$ maka dapat dikatakan secara simultan nilai tukar rupiah dan jumlah uang beredar berpengaruh signifikan pada $\alpha = 5\%$ terhadap indeks harga saham otomotif di Bursa Efek Indonesia. Nilai koefisien determinasi (R^2) diperoleh sebesar 0,791 memiliki pengertian bahwa perubahan indeks harga saham otomotif dapat dijelaskan oleh nilai tukar rupiah dan jumlah uang beredar sebesar 79,1 % sedangkan sisanya dijelaskan oleh faktor-faktor lain yang tidak ada dalam model penelitian ini.

Kata Kunci : Indeks Harga Saham Otomotif, Nilai Tukar Rupiah, Jumlah Uang Beredar

ABSTRACT

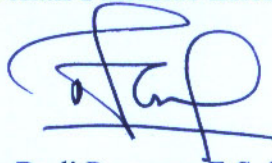
PUJI ASTUTI. “The Impact of exchange rate and money supply on Automotive Stock Price Index in Bursa Efek Indonesia 2010-2012.” Thesis. The Education of Cooperation Economic. Economic and Administration Major. Faculty of Economic. Universitas Negeri Jakarta. 2013. Lecturer Advisor: Dr. Saparuddin, SE, M.Si and Rd. Tuti Sariwulan, SE, M.Si

This research is purposed to analyze the impact of the exchange rate and money supply on Automotive Stock Price Index in Bursa Efek Indonesia. The data used in this research are the secondary data, that type of time series data for 2010-2012 periods, presented in monthly data, source from Indonesian Capital Market Electronic Library and Bank of Indonesia. The method of this research is expose facto. The technique of data analysis in this research is the multiple regression analysis. Based on multiple regressions by using SPSS 16.0 SPSS software, the output has indicated the exchange rate (X1) is negatively and significantly affects the automotive stock price index (Y) in Bursa Efek Indonesia. While, the money supply (X2) is positively and significantly affects the automotive stock price index (Y) in Bursa Efek Indonesia. Based on the test with respect to F significant value = $0,000 < 0,05$, it can concluded that the exchange rate and money supply as togetherness on $\alpha = 5\%$ is significantly affects the automotive stock price index in Bursa Efek Indonesia. Determination coefficient value that obtained is 0,791, it means that the changes of automotive stock price index could be explained by the exchange rate and money supply as amount 79,1 %. While, the rest could be explained by others factor that can not mentioned in this research model.

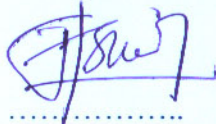
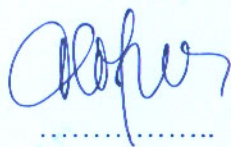
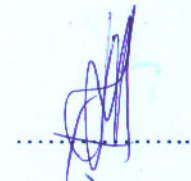
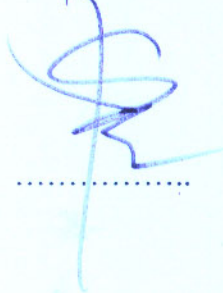

Keywords : Automotive Stock Price Index, Exchange Rate, Money Supply.

LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI

Penanggung Jawab
Dekan Fakultas Ekonomi



Drs. Dedi Purwana E S, M.Bus.
NIP. 19671207 199203 1 001

Nama	Jabatan	Tanda Tangan	Tanggal
1. <u>Dr. Siti Nurjanah, S.E., M.Si.</u> NIP. 19720114 199802 2 001	Ketua		1 Agustus '13
2. <u>Dr. Harya Kuncara, S.E., M.Si.</u> NIP. 19700207 200812 1 001	Sekretaris		1 Agustus '13
3. <u>Sri Indah Nikensari, S.E., M.Si.</u> NIP. 19620809 199003 2 001	Penguji Ahli		30 Juli '13
4. <u>Dr. Saparuddin M, S.E., M.Si.</u> NIP. 19770115 200501 1 001	Pembimbing I		30 Juli '13
5. <u>Dra. Rd. Tuty Sariwulan, M.Si.</u> NIP. 19580722 198603 2 001	Pembimbing II		30 Juli '13

Tanggal Lulus: 29 Juli 2013

PERNYATAAN ORISINALITAS

Dengan ini saya menyatakan bahwa:

1. Skripsi ini merupakan karya asli dan belum pernah diajukan untuk mendapatkan gelar akademik sarjana di Universitas Negeri Jakarta.
2. Skripsi ini belum dipublikasikan, kecuali secara tertulis dengan jelas dicantumkan sebagai acuan dalam naskah dengan disebutkan nama pengarang dan dicantumkan dalam daftar pustaka.
3. Pernyataan ini saya buat dengan sesungguhnya dan apabila dikemudian hari terdapat penyimpangan dan ketidakbenaran, maka saya bersedia menerima sanksi akademik berupa pencabutan gelar, serta sanksi lainnya sesuai dengan norma yang berlaku di Universitas Negeri Jakarta.

Jakarta, Juli 2013

Yang membuat pernyataan



Puji Astuti
8105097417

LEMBAR PERSEMBAHAN

This skripsi is dedicated for the loveliest parents, Muhammad and Lamsih. Thank you for being the best parents a daughter could ever wish for. Sorry for making you worried when I failed on my first seminar. With your constant support, I can trough that hard time and finishing my skripsi nicely. Thank you, Pa, Ma, I love you with all my heart, today and forever more.

For the best brothers in the world, Erwin, Rafly, and Roni. Abang, Thank you for always being there, protecting me, your one and only sister. Thank you for always being best big brothers for me. It's a bit hard for me to write this phrase to you, well, I love you!

*I really need to thank God for giving me such a lovely family...
Alhamdulillah.. Thank God.*

Jakarta, Juli 2013

Puji Astuti

KATA PENGANTAR

Puji dan syukur kehadiran Allah SWT, karena atas rahmat, kekuatan dan ridho-Nya, sehingga penulis dapat menyelesaikan skripsi yang berjudul **“Pengaruh Nilai Tukar Rupiah dan Jumlah Uang Beredar Terhadap Indeks Harga Saham Otomotif di Bursa Efek Indonesia Tahun 2010-2012”**. Skripsi ini disusun sebagai salah satu syarat untuk memperoleh gelar Sarjana Pendidikan pada Fakultas Ekonomi Universitas Negeri Jakarta.

Pada kesempatan ini penulis ingin menyampaikan rasa terimakasih yang sebesar-besarnya kepada semua pihak yang telah membantu, memberikan bimbingan, saran, motivasi, dan dukungan selama proses pengerjaan skripsi ini. Ucapan terima kasih ini penulis tujukan kepada :

1. Bapak Drs. Dedi Purwana E S, M.Bus., selaku Dekan Fakultas Ekonomi
2. Bapak Ari Saptono, S.E, M.Pd., selaku Ketua Jurusan Ekonomi dan Administrasi
3. Bapak Dr. Saparuddin, S.E, M.Si., selaku Ketua Program Studi Pendidikan Ekonomi dan dosen pembimbing I yang telah memberikan banyak saran dan arahan serta motivasi dalam penyusunan skripsi ini.
4. Ibu Dr. Siti Nurjanah, SE, M.Si selaku Ketua Konsentrasi Pendidikan Ekonomi Koperasi
5. Ibu Rd. Tuty Sariwulan, SE. M.Si selaku dosen pembimbing II yang telah sangat sabar memberikan saran dan arahan serta motivasi dalam penyusunan skripsi ini.

6. *My Everything*, Bapak dan Mama tercinta terimakasih untuk segala dukungan moril serta materil, pengorbanan, perhatian, cinta, kasih sayang, serta doanya yang tulus dan tak pernah putus selama ini. Kalian adalah motivasi terkuat bagi peneliti untuk bisa segera menyelesaikan skripsi ini.
7. *The irreplaceable girls that I love so much*, Chitra, Ratih, Metta and Shinta. *May us last forever as CROMPS*.
8. Roro, Susan, Via, Woro dan Felly. Terimakasih atas segala dukungan serta doa penuh cinta yang kalian berikan untuk peneliti selama ini.
9. Tissa Aprilia. *Without her, I have no idea how my campus life would be*.
10. Bayu, teman diskusi yang selalu bisa diandalkan. Elvin, Mega dan Akbar yang selalu membawa keceriaan. *Thanks for every single thing you gave*.
11. *Last but of course they're not least*, Serli, Tiwi, Ade, Della, Astrid, Sinta, Isti, Ika, Libri, Dimas, Roy, Yayan, *and everyone in the loveliest class EKOP NONREG 2009. You gave me a lot of beautiful and fun memories, guys!*

Penulis menyadari bahwa skripsi ini masih jauh dari sempurna, oleh karena itu, dengan segala kerendahan hati penulis menerima kritik dan saran yang membangun untuk perbaikan di masa yang akan datang. Akhir kata, semoga skripsi ini bermanfaat bagi pembaca.

Jakarta, Juli 2013

Puji Astuti