

**FAKTOR – FAKTOR YANG MEMPENGARUHI PERMINTAAN UANG
KARTAL DI INDONESIA TAHUN 2000.Q₁ – 2013.Q₄**

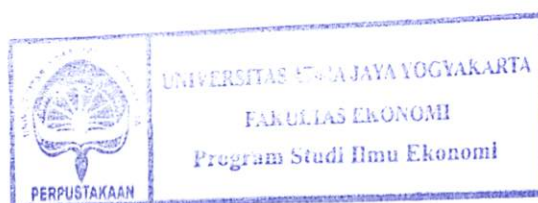
SKRIPSI

Untuk Memenuhi Sebagian Persyaratan Mencapai Derajat Sarjana Ekonomi (S1)
Pada Program Studi Ekonomi Pembangunan
Fakultas Ekonomi Universitas Atma Jaya Yogyakarta



Disusun Oleh:
Romanus Heru Setiawan
NPM : 09 11 17813

FAKULTAS EKONOMI
UNIVERSITAS ATMA JAYA YOGYAKARTA
OKTOBER 2015



SKRIPSI

**FAKTOR – FAKTOR YANG MEMPENGARUHI PERMINTAAN UANG
KARTAL DI INDONESIA TAHUN 2000.Q₁ – 2013.Q₄**

Disusun Oleh:

Romanus Heru Setiawan

NPM : 09 11 17813

Telah dibaca dan disetujui oleh:

Pembimbing Utama,

Ign. Agus Wantara, Drs., M.Si

Tanggal 26 Agustus 2015

SKRIPSI

FAKTOR – FAKTOR YANG MEMPENGARUHI PERMINTAAN UANG KARTAL DI INDONESIA TAHUN 2000.Q₁ – 2013.Q₄

Yang dipersiapkan dan disusun oleh:

Romanus Heru Setiawan

NPM : 09 11 17813

Telah dipertahankan di depan Panitia Penguji
pada tanggal 02 Oktober 2015
dan dinyatakan telah memenuhi syarat untuk diterima
sebagai salah satu persyaratan untuk mencapai gelar Sarjana Ekonomi
(S1) Program Studi Ekonomi Pembangunan

SUSUNAN PANITIA PENGUJI

Ketua Panitia Penguji,

Y. Sri Susilo, Drs., M.Si

Anggota Panitia Penguji

Andreas Sukamto, Drs., M.Si

I. Agus Wantara, Drs., M.Si

Yogyakarta, 02 Oktober 2015

Dekan Fakultas Ekonomi

Universitas Atma Jaya Yogyakarta



Drs. Budi Suprpto, M. B. A., Ph.D

PERNYATAAN

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

FAKTOR – FAKTOR YANG MEMPENGARUHI PERMINTAAN UANG KARTAL DI INDONESIA TAHUN 2000.Q₁ – 2013.Q₄

Benar-benar hasil karya saya sendiri. Pernyataan, ide maupun kutipan baik langsung maupun tak langsung yang bersumber dari tulisan atau ide orang lain dinyatakan secara tertulis dalam skripsi ini dalam catatan perut dan 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 akan saya kembalikan kepada Universitas Atma Jaya Yogyakarta.

Yogyakarta, 26 Agustus 2015

Yang menyatakan



Romanus Heru Setiawan

KATA PENGANTAR

Puji dan syukur penulis panjatkan kepada Tuhan Yang Maha Esa atas segala berkat, rahmat, serta penyertaan-Nya selama ini, sehingga penulis dapat menyelesaikan tugas akhir ini dengan baik. Tugas akhir ini merupakan salah satu pemenuhan atas syarat perolehan gelar Sarjana Strata 1 pada Fakultas Ekonomi Universitas Atma Jaya Yogyakarta.

Pada kesempatan ini penulis ingin mengucapkan terima kasih kepada semua pihak yang telah berkenan membantu dalam penelitian ini. Atas bantuannya baik berupa ide, gagasan, materi maupun bantuan berupa spirit mampu mendorong penulis untuk menyelesaikan penelitian dengan baik. Penulis mengucapkan banyak terima kasih kepada pihak – pihak yang telah membantu dalam penyusunan skripsi ini, yaitu kepada :

1. Tuhan Yesus, karena berkat dan rahmat-Nya skripsi ini dapat terselesaikan dengan baik.
2. Bapak Ign. AgusWantara, Drs., M.Si selaku dosen pembimbing yang telah membimbing dan member petunjuk yang sangat berguna bagi penulis sehingga penulisan skripsi ini dapat terselesaikan dengan baik.
3. Kepada orang tua beserta kakak dan adik - adikku yang selalu memberikan dukungan moril, material, dan doa kepada penulis.
4. Bapak Alm. B. Kuspradono, DiplVolks., Mec.Dev yang telah memberikan waktu dan ilmunya selama satu setengah tahun terakhir sebelum beliau dipanggil Tuhan.

5. Ibu Yenny Patnasari, Dra., M.Si yang telah memberikan masukan selama pengerjaan skripsi ini.
6. Ibu AM. Rini Setyastuti, SE., M.Si yang telah memberikan masukan selama pengerjaan skripsi ini.
7. Seluruh dosen dan staff Fakultas Ekonomi Universitas Atma Jaya Yogyakarta yang telah memberikan ilmunya pada penulis.
8. Kepada Patricia Mayang Harumi Mekaringtyas, terima kasih karena selalu mendukung dan memberikan motivasi selama pengerjaan skripsi ini.
9. Teman – teman yang selalu mendukung dan mendoakan sampai skripsi ini selesai. Terima kasih atas doa dan dukungannya.

Semoga Tuhan Yang Maha Pengasih berkenan membalas budi baik yang telah diberikan. Akhir kata, penulis berharap semoga skripsi ini dapat bermanfaat bagi semua pihak yang membutuhkannya.

Yogyakarta, September 2015
Penulis,

Romanus Heru Setiawan

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN PEMBIMBING	ii
HALAMAN PENGESAHAN SKRIPSI	iii
HALAMAN PERNYATAAN	iv
KATA PENGANTAR.....	v
HALAMAN MOTTO DAN PERSEMBAHAN	vii
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiii
ABSTRAK	xiv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Tujuan Penelitian	6
1.4 Manfaat Penelitian	6
1.5 Hipotesis Penelitian	7
1.6 Sistematika Penulisan	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	9
2.1 Definisi Uang	9
2.2 Teori Permintaan Uang	10

2.2.1	Teori Kuantitas Uang	11
2.2.1.1	Teori Kuantitas Irving Fisher	11
2.2.1.2	Teori Cambridge	12
2.2.2	Teori Keynes	13
2.2.3	Perkembangan Teori Keynes	15
2.2.3.1	Permintaan Uang Untuk Transaksi (Baumol-Tobin)	16
2.2.3.2	Permintaan Uang Untuk Spekulasi (Tobin)	16
2.2.4	Teori Kuantitas Modern	17
2.3	Suku Bunga.....	20
2.4	Pendapatan Nasional	21
2.5	Literatur / Studi Terkait	23
BAB III METODE PENELITIAN.....		26
3.1	Jenis dan Sumber Data	26
3.2	Model	26
3.2.1	Model Teoritis	26
3.2.2	Model Yang Ditaksir	28
3.3	Alat Analisis.....	29
3.3.1	Uji Asumsi Klasik	29
3.3.1.1	Uji Multikolinearitas	29
3.3.1.2	Uji Autokorelasi	31
3.3.1.3	Uji Heteroskedastitas	33
3.3.2	Uji Statistik	34
3.3.2.1	Uji Koefisien Regresi Secara Individu (Uji – t)	35
3.3.2.2	Uji Koefisien Regresi Secara Keseluruhan (Uji – F)	38

3.3.2.3 Koefisien Determinasi (R^2)	39
3.4 Definisi Operasional	40
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....	42
4.1 Gambaran Umum	42
4.1.1 Perkembangan Jumlah Uang Kartal Di Indonesia	42
4.1.2 Perkembangan Produk Domestik Bruto (PDB) Di Indonesia.....	43
4.1.3 Perkembangan Suku Bunga Deposito Berjangka Di Indonesia ...	45
4.2 Hasil dan Pembahasan.....	46
4.3 Uji Asumsi Klasik	47
4.3.1 Uji Multikolinearitas	47
4.3.2 Uji Autokorelasi	49
4.3.3 Uji Heteroskedastisitas	50
4.4 Uji Statistik.....	52
4.4.1 Uji – t	52
4.4.2 Uji – F	52
4.4.3 Koefisien Determinasi	53
4.5 Diskusi Ekonomi	53
BAB V PENUTUP	56
5.1 Kesimpulan	56
5.2 Saran.....	56
DAFTAR PUSTAKA.....	58
LAMPIRAN	60

DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 4.1 Hasil Estimasi Model PAM Permintaan Uang Riil Persamaan (3.8)	47
Tabel 4.2 Hasil Estimasi Model Regresi <i>Auxillary</i> Persamaan (3.9), (3.10), dan (3.11)	48
Tabel 4.3 <i>Klein's Rule of Thumb</i> untuk Hasil Estimasi Model Utama Persamaan (3.8) dan Model <i>Auxillary</i> Persamaan (3.9), (3.10), dan (3.11)	49
Tabel 4.4 Uji Heteroskedastisitas: Metode <i>White's Heteroskedasticity Test</i>	51

DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 1.1 Jumlah Uang Kartal Riil (M^d)	3
Gambar 1.2 Produk Domestik Bruto	4
Gambar 1.3 Tingkat Suku Bunga	5
Gambar 3.1 Daerah Hipotesis Uji Durbin Watson	32
Gambar 3.2 Daerah Penerimaan & Penolakan H_0 untuk Uji-t (t -test) sisi Positif	36
Gambar 3.3 Daerah Penerimaan & Penolakan H_0 untuk Uji-t (t -test) sisi Negatif	37
Gambar 3.4 Daerah Penerimaan & Penolakan H_0 untuk Uji-F (F -test)	39
Gambar 4.1 Perkembangan Jumlah Uang Kartal Tahun 2000-2013 (dalam satuan miliar rupiah)	43
Gambar 4.2 Perkembangan Produk Domestik Bruto (PDB) Tahun 2000-2013 (dalam satuan miliar rupiah)	44
Gambar 4.3 Perkembangan Suku Bunga Deposito Berjangka Tahun 2000-2013 (dalam satuan persen)	45
Gambar 4.4 Kriteria Penolakan dan Penerimaan Hipotesis H_0 dan H_0^*	50

DAFTAR LAMPIRAN

	Halaman
Lampiran 1 Perkembangan Uang Kartal di Indonesia (dalam satuan miliar rupiah)	61
Lampiran 2 Perkembangan Produk Domestik Bruto di Indonesia Atas Dasar Harga Konstan 2000 Menurut Lapangan Usaha (dalam satuan miliar rupiah)	62
Lampiran 3 Perkembangan Suku Bunga Deposito Berjangka di Indonesia Menurut Bank Umum (dalam satuan persen)	63
Lampiran 4 Data Penelitian yang Diestimasi	64
Lampiran 5 Hasil Estimasi Model Linear PAM, Persamaan (3.8)	66
Lampiran 6 Uji Multikolinearitas: Hasil Estimasi Model Auxillary 1, Persamaan (3.9)	67
Lampiran 7 Hasil Estimasi Model Auxillary 2, Persamaan (3.10)	68
Lampiran 8 Hasil Estimasi Model Auxillary 3, Persamaan (3.11)	69
Lampiran 9 Uji Heteroskedastisitas	70

FAKTOR – FAKTOR YANG MEMPENGARUHI PERMINTAAN UANG KARTAL DI INDONESIA TAHUN 2000.Q₁ – 2013.Q₄

Disusun Oleh:
Romanus Heru Setiawan
NPM: 09 11 17813

Pembimbing
Ign. Agus Wantara, Drs., M.Si

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh pendapatan nasional riil, suku bunga riil, serta permintaan uang riil satu periode sebelumnya terhadap permintaan uang riil. Penelitian ini menggunakan data runtut waktu (*time series*) dalam bentuk kuartalan dengan periode pengamatan tahun 2000.Q₁ – 2013.Q₄, yang diperoleh dari Bank Indonesia (BI). Analisis dalam penelitian ini menggunakan model dinamik yang secara empiris akan diuji dengan menggunakan model *Partial Adjustment Model (PAM)*.

Temuan dalam penelitian ini yaitu pendapatan nasional riil berpengaruh positif terhadap permintaan uang riil di Indonesia tahun 2000.Q₁ – 2013.Q₄. Suku bunga riil tidak berpengaruh negatif terhadap permintaan uang riil di Indonesia tahun 2000.Q₁ – 2013.Q₄. Permintaan uang riil satu periode sebelumnya berpengaruh positif terhadap permintaan uang riil di Indonesia tahun 2000.Q₁ – 2013.Q₄. Pendapatan nasional riil, suku bunga riil, dan permintaan uang riil satu periode sebelumnya berpengaruh secara keseluruhan terhadap permintaan uang riil di Indonesia 2000.Q₁ – 2013.Q₄.

Kata Kunci : *Permintaan uang, pendapatan nasional, suku bunga, Partial Adjustment Model (PAM)*.