



**PENGARUH PRODUK DOMESTIK BRUTO, SUKU BUNGA
DEPOSITO DAN INFLASI TERHADAP JUMLAH UANG
BEREDAR DI INDONESIA PERIODE 2000.1-2006.4**

SKRIPSI

Oleh :

**DYAH IDA FAUJIYA
NIM. 030810101147**

**ILMU EKONOMI
FAKULTAS EKONOMI
UNIVERSITAS JEMBER
2008**

Pengaruh Produk Domestik Bruto, Suku Bunga Deposito dan Inflasi terhadap Jumlah Uang Beredar di Indonesia Periode 2000.1-2006.4

Dyah Ida Faujiya

Jurusan Ilmu Ekonomi, Fakultas Ekonomi, Universitas Jember

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh Produk Domestik Bruto, suku bunga deposito dan inflasi terhadap jumlah uang beredar di Indonesia periode 2000.1-2006.4. Metode analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah uji kausalitas Granger dan *vector error correction model* (VECM) dengan *impulse response* dan *variance decomposition*.

Hasil uji kausalitas Granger menunjukkan bahwa ditemukan hubungan kausal antara Produk Domestik Bruto dengan jumlah uang beredar dan suku bunga dengan jumlah uang beredar, sedangkan inflasi dengan jumlah uang beredar tidak ditemukan hubungan kausal. Hasil dari *impulse response* menunjukkan bahwa jumlah uang beredar di respon positif adanya kejutan Produk Domestik Bruto, jumlah uang beredar di respon positif adanya kejutan suku bunga, dan jumlah uang beredar di respon negatif adanya kejutan inflasi. Hasil *variance decomposition* menunjukkan bahwa kontribusi Produk Domestik Bruto dalam menjelaskan jumlah uang beredar sampai dengan 50%, kontribusi suku bunga dalam menjelaskan jumlah uang beredar sampai dengan 7%, dan kontribusi inflasi dalam menjelaskan jumlah uang beredar sampai dengan 24%. Kondisi tersebut menunjukkan bahwa variabel kebijakan di respon lebih cepat oleh Produk Domestik Bruto daripada variabel-variabel yang lain.

Kata kunci : Produk Domestik Bruto, suku bunga deposito, inflasi, dan jumlah uang beredar.

The Effect of Gross Domestic Product, Deposit Interest Rate and Inflation for Money Supply in Indonesia during Period 2000.1-2006.4

Dyah Ida Faujiya

Jurusan Ilmu Ekonomi, Fakultas Ekonomi, Universitas Jember

ABSTRACT

The purpose of this research was to know effect of gross domestic product, deposit interest rate and inflation for money supply in Indonesia during period 2000.1-2006.4. Analysis method used in this research are Granger Causality Test and vector error correction model (VECM) with impulse response and variance decomposition.

The result of Granger causality test showed that finded relation between of gross domestic product with money supply and interest rate with money supply, however inflation with money supply not finded of causal relation. The result of impulse response showed that money supply positive responded by the shock of gross domestic product, money supply positive responded by the shock of interest rate, and money supply negative responded by the shock of inflation. The result of variance decomposition showed that contribution of gross domestic product in explains money supply until 50%, contribution of interest rate in explains money supply until 7%, and contribution of inflation in explains money supply until 24%. Condition it showed that of policy variable is responded by gross domestic product faster than others variables.

Keyword : gross domestic product, deposit interest rate, inflation, and money supply.

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERNYATAAN	ii
HALAMAN PERSETUJUAN	iii
HALAMAN PENGESAHAN	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN	v
HALAMAN MOTTO	vi
ABSTRAKSI	vii
ABSTRACT	viii
KATA PENGANTAR	ix
DAFTAR ISI	xi
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
DAFTAR LAMPIRAN	xv
BAB I. PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Tujuan dan Manfaat Penelitian	4
BAB II. TINJAUAN PUSTAKA	6
2.1 Landasan Teori	6
2.2 Tinjauan Penelitian Sebelumnya	14
2.3 Hipotesis	16
BAB III. METODE PENELITIAN	17
3.1 Jenis dan Sumber Data	17
3.2 Spesifikasi Model.....	17
3.3 Metode Analisis Data.....	17