

**ANALISIS KAUSALITAS ANTARA PERTUMBUHAN  
EKONOMI DENGAN TINGKAT INVESTASI  
DI DAERAH ISTIMEWA YOGYAKARTA  
TAHUN 1980 - 2003**



Skripsi

Digunakan Untuk Memenuhi Tugas dan Syarat-syarat  
Guna Memperoleh Gelar Sarjana Ekonomi  
Jurusan Studi Ekonomi Pembangunan Pada Fakultas Ekonomi  
Universitas Muhammadiyah Surakarta

Oleh :

NAMA : MUH AGUNG NUGROHO

NIM : B 300000099

**FAKULTAS EKONOMI JURUSAN EKONOMI  
PEMBANGUNAN UNIVERSITAS MUHAMMADIYAH  
SURAKARTA**

**2007**

## ABSTRAKSI

Penelitian ini berjudul "Analisis Kausalitas antara pertumbuhan Ekonomi dengan tingkat investasi di daerah Istimewa Yogyakarta tahun 1980 - 2003". Tujuan penelitian ini untuk mengetahui apakah terdapat hubungan antara pertumbuhan ekonomi (PDRB) dengan investasi (PMDN) selama periode tertentu.

Penelitian ini menggunakan model uji kausalitas granger. Kausalitas dari hasil penelitian diketahui bahwa hubungan kausalitas satu arah antara Penanaman Modal Dalam Negeri (PMDN) terhadap Pertumbuhan Ekonomi (PDRB) pada probabilitas 0,06503 hal ini ditunjukkan dari hasil hipotesis nol dan uji kausalitas. Granger dengan menggunakan kriteria  $\alpha = 0,1$  maka dapat disimpulkan hipotesa nol dari variabel penanaman modal dalam negeri terhadap pertumbuhan ekonomi, dapat dikatakan bahwa tingkat investasi (PMDN) mempengaruhi pertumbuhan ekonomi (PDRB) yang ditunjukkan dengan  $F_{hitung}$  sebesar 3.81177 dengan probabilitas hubungan variabel penanaman modal dalam negeri terhadap pertumbuhan ekonomi (PDRB) sebesar 0,06503 dan pertumbuhan ekonomi (PDRB) tidak mempengaruhi investasi sampai lag 3 pada  $\alpha = 10\%$ .

Untuk mendapatkan hasil eskimasi yang baik maka dilakukan pengujian dengan tahapan uji stasioneritas, uji kointegrasi dan uji kausalitas granger. Dari ketiga uji tersebut tidak ada masalah.

Kata Kunci : Pertumbuhan dan tingkat investasi, kausalitas granger, stasioneritas dan kointegrasi.

Surakarta, Februari 2007

**Didit Purnomo, SE, M.Si**

Mengetahui Dekan  
Fakultas Ekonomi

**Drs. Syamsudin, MM.**

## **PENGESAHAN**

Yang bertanda tangan di bawah ini telah membaca skripsi yang berjudul :  
**"Analisis Kausalitas antara Pertumbuhan Ekonomi dengan Tingkat  
Investasi Di Daerah Istimewa Yogyakarta tahun 1980 - 2003"**.

Yang ditulis oleh :

**MUH AGUNG NUGROHO**  
**NIM. B 300000099**

Menyatakan bahwa skripsi tersebut telah memenuhi syarat untuk diterima.

Pembimbing I

**Didit Purnomo, SE**

Mengetahui  
Dekan Fakultas Ekonomi

**Drs. Syamsudin, MM.**

## **HALAMAN MOTTO**

*Kelemahan yang ada pada manusia adalah disaat manusia itu tidak bisa menerima kenyataan disaat dia jatuh dan kalah (Abdullah)*

*Untuk mencapai impian dan harapan, pengorbanan adalah harga yang harus di bayar dan doa adalah iringan seruan hati yang menjembatani antara abdi dan Illahi (Abdullah)*

## **HALAMAN PERSEMBAHAN**

Skripsi ini merupakan hasil kerja keras yang tak lepas dari jasa dan doa orang-orang di sampingku. Skripsi ini kupersembahkan untuk :

- Ayah dan Ibundaku yang tereinta yang telah mencurahkan doa, kasih sayang, motivasi, fasilitas dan pengorbanan dengan segala ketulusan hati.
- Kakak-kakakku, adek-adekku, semoga kalian selalu mendapatkan kebahagiaan dan keselamatan
- Keluarga besarku yang menjadikan hidupku lebih berarti
- Sahabat-sahabatku yang selalu setia menunggu dan memberi dorongan

## **KATA PENGANTAR**

Bismillahirrohanirrohim

Assalamu'alaikum Wr. Wb.

Segala puji dan syukur selalu penulis panjatkan kehadirat Allah SWT, yang telah memberikan rahmat, hidayah dan ridho-Nya, sehingga penulis dapat menyelesaikan skripsi dengan judul "ANALISIS KAUSALITAS ANTARA PERTUMBUHAN EKONOMI DENGAN TINGKAT INVESTASI DI DAERAH ISTIMEWA YOGYAKARTA TAHUN 1980 - 2003". Sebagai salah satu syarat untuk memperoleh gelar Sarjana Ekonomi Jurusan Ilmu Ekonomi Studi Pembangunan pada Fakultas Ekonomi UMS.

Penulis berharap dikelak kemudian hari karya ini dapat bermanfaat bagi semua pihak yang berkepentingan. Penulis menyadari bahwa keberhasilan dalam menyelesaikan skripsi ini tidak terlepas dari bantuan berbagai pihak sehingga pada kesempatan ini penulis mengucapkan terima kasih kepada :

1. Bp. Didit Purnomo, SE selaku pembimbing utama yang sudah dengan sabar dan bijaksana selalu memberikan bimbingan dan petunjuk untuk penyusunan skripsi ini
2. Bapak Yuni Prihadi Utomo selaku ketua jurusan IESP
3. Bapak dan Ibu Dosen yang telah memberi bekal ilmu pengetahuan bagi penulis selama menempuh studi di IESP.
4. Bapak dan Ibundaku dan keluargaku tercinta, terima kasih atas segala kasih sayang, dukungan, semangat dan doa dan semuanya.
5. Teman-temanku, Ari, Somat, Timur, Aris, Nawir, thanks for your friendship guys
6. Teman-teman IESP angkatan 2000 kelas B yang tidak dapat disebutkan satu per satu
6. Teman-teman Sepak Bola

Mudah-mudahan semua bantuan dan kebaikan yang telah diberikan kepada penulis mendapatkan balasan dari Allah SWT, harapan penulis semoga skripsi ini bermanfaat bagi para pembaca..... Amiin.

Wassalamu'alaikum Wr. Wb.

Surakarta, Februari 2007

**Penulis**

## DAFTAR ISI

	Halaman
Halaman Judul .....	i
Abstraksi .....	ii
Halaman Pengesahan.....	iii
Halaman Motto.....	iv
Halaman Persembahan.....	v
Kata Pengantar.....	vi
Daftar Isi.....	viii
Daftar Tabel.....	x
Daftar Grafik .....	xi
<b>BAB I PENDAHULUAN .....</b>	<b>1</b>
A. Latar Belakang Masalah .....	1
B. Perumusan Masalah.....	11
C. Tujuan Penelitian.....	11
D. Manfaat Penelitian.....	11
E. Metode Penelitian .....	12
F. Sistematika Penulisan .....	14
<b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA .....</b>	<b>15</b>
A. Pertumbuhan Ekonomi .....	15
1. Pengertian .....	15
2. Perkembangan Model dan Teori Pertumbuhan .....	19
B. Investasi .....	34
1. Pengertian .....	34
2. Peranana Investasi .....	47
C. Hubungan antara Investsi dan Pertumbuhan Ekonomi.....	48
D. Penelitian yang Terdahulu .....	54
E. Hipotesa .....	55



BAB III METODE PENELITIAN .....	56
A. Data dan Sumber Data .....	56
B. Definisi Operasional Variabel .....	56
C. Metode Analisis Data .....	56
D. Rencana Analisis Data .....	57
BAB IV ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN .....	61
A. Gambaran Umum .....	61
1. Keadaan Alam .....	61
2. Keadaan Iklim .....	63
B. Pertumbuhan Ekonomi dan Investasi di Yogyakarta .....	63
C. Analisis Data .....	64
1. Uji Stasioneritas .....	65
2. Uji Unit Root Augmented Dickey Fuller (ADF) .....	66
3. Uji Unit Root (ADF) .....	66
4. Uji Kausalitas Granger .....	67
D. Interpretasi Ekonomi .....	68
BAB V PENUTUP .....	70
A. Kesimpulan.....	70
B. Saran .....	70

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

## DAFTAR TABEL

Tabel 4.1. Data Pertumbuhan Ekonomi .....	63
Tabel 4.2. Data Penanaman Modal Dalam Negeri .....	64
Tabel 4.3. Dickey Fuller (DF) Untuk Variabel PMDN .....	65
Tabel 4.4. Dickey Fuller (DF) Untuk variabel PDRB .....	65
Tabel 4.5. Augmented Dickey Fuller (ADF) PDRB .....	66
Tabel.4.6. Augmented Dickey Fuller (ADF) PMDN .....	66
Tabel 4.7. Hasil Uji Kausalitas Granger .....	67
Langkah-langkah dalam PTK.....	19

## DAFTAR GRAFIK

Gambar : Pertumbuhan Ekonomi menurut Teori Klasik .....	31
Gambar : Penduduk Optimal .....	32
Gambar : Kemungkinan Produksi .....	32
Gambar : Kurva Indifference .....	39
Gambar : Investasi Langsung .....	40
Gambar : Peranan Investasi .....	47
Gambar : Hubungan Pendapatan dengan Investasi .....	50