

**ANALISIS KAUSALITAS ANTARA HARGA MINYAK DUNIA
DENGAN INFLASI DUNIA
TAHUN 1980 - 2005
(Pendekatan Error Correction Model)**



SKRIPSI

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

Oleh :

Tri Haryono

B300030074

**FAKULTAS EKONOMI
UNIVERSITAS MUHAMMADIYAH SURAKARTA**

2007

PENGESAHAN

Yang bertanda tangan dibawah ini telah membaca skripsi dengan judul:

“ANALISIS KAUSALITAS ANTARA HARGA MINYAK DUNIA DENGAN INFLASI DUNIATAHUN 1980 – 2005 (Pendekatan Error Correction Model atau ECM)”.

Yang ditulis oleh:

Nama : TRI HARYONO

NIM : B3000303074

Penandatanganan berpendapat bahwa skripsi ini telah memenuhi syarat untuk diterima.

Surakarta, Juli 2007
Pembimbing

(Eny Setyowati, SE.)

Mengetahui
Dekan Fakultas Ekonomi
Universitas Muhammadiyah Surakarta

(Drs. H. Syamsudin, MM.)

MOTTO

Sesuatu yang sulit itu bukanlah suatu hambatan untuk mencapai keberhasilan melainkan tantangan dalam pencapaian keberhasilan

(penulis)

Dalam hidup apabila dilandasi dengan rasa semangat maka keberhasilan akan semakin dekat.

(penulis)

Hentikan membuang waktu. Mulai mengelola dan menginvestikan waktu. Hal ini akan merupakan investasi paling penting berharga untuk diri dan perusahaan.

(William R. Wilkinson)

Menunda merupakan masalah yang mahal dan melelahkan bagi kita semua. Cara termudah mengatasinya ialah pertam-tama dengan berusaha jangan sampai ia dapat terjadi.

(Merrill E. Douglass)

PERSEMBAHAN

Dengan penuh cinta

Teriring doa dan puji syukur kehadiran Allah SWT penulis persembahkan sederhana ini

kepada :

Bapak dan ibu tercinta yang telah mengiringi langkahku dengan doa dan kasih sayang yang tidak terhingga betapa aku ingin mamperssembahkan yang terbaik atas segala perjuangan yang engkau lakukan untuk cita-cita dan masa depanku.

Kedua kakakku hanya karya sederhana ini yang dapat kuperssembahkan. Atas segala doa dan kasih sayangmu yang tak pernah putus.

KATA PENGANTAR

Bismillahirrahmanirrohim

Assalamu'alaikum Wr. Wb.

Alhamdulillahil'alamin, dengan segala puji syukur kahadirat Allah SWT yang telah memberikan berkah, rahmat, ilmu dan kekuatan kepada kita. Puji syukur kepada Allah SWT dengan kemudahan kesempatan dan kesehatan yang dianugerahkan-Nya kepada penulis sehingga dapat menyelesaikan skripsi ini dengan judul: "ANALISIS KAUSALITAS ANTARA HARGA MINYAK DUNIA DENGAN INFLASI DUNIA TAHUN 1980-2005".

Skripsi ini diajukan guna melengkapi persyaratan untuk memperoleh gelar sarjana Ilmu Ekonomi Studi Pembangunan Universitas Muhammadiyah Surakarta.

Dengan segenap ketulusan hati penulis mengucapkan terima kasih sebesar-besarnya atas bantuan dan dukungan dari berbagai pihak. Semog amal baik kita dibalas oleh Allah SWT. Ucapan terima kasih penulis sampaikan kepada:

1. Bapak Drs. Symsudin MM selaku dekan Fakultas Ekonomi Universitas Muhammadiyah Surakarta.
2. Bapak Drs. Yuni Prihadi Utomo, selaku kepala jurusan IESP Universitas Muhammadiyah Surakarta.
3. Ibu Eny Setyowati, SE. selaku dosen pembimbing skripsi saya yang telah bersedia meluangkan waktu untuk memberikan bimbingan dan petunjuk dalam penyusunan skripsi ini.

4. Seluruh staff pengajar (Bapak/Ibu dosen) Fakultas Ekonomi Universitas Muhammdiyah Surakarta.
5. Bapak Mardani bagian administrasi yang telah banyak membantu.
6. Bapak dan Ibu tercinta yang tak jenuh memberikan doa semangat, kasih sayang dan segala fasilitas yang berlimpah atas segala penulis butuhkan.
7. Kakakku (Mas Supri dan Mas Joko) terima kasih atas dukungan, doa dan segala fasilitas yang telah diberikan kepadaku.
8. Teman-teman terbaikku Yusut Hot Girl makasih atas dorongan dan barang2 apiknya (jo lali pengamane yo le..!), David Don't go anywhere! (makasih atas persinggahan sementara waktu dikampus dan semangat yang engkau berikan.
9. Setiawan makasih telah diolahkan dataku (lanjutkan pusing2 tiap malam y00..!) , Buat Respati idol (dah jadi bintang belom?),buat Gendut Muhammad F), gimana kabar bolo-bolomu itu seperti SRONTO, kuriman, pak Binadkk"O ya Den Ngarso keprok ndase wae marai kemlinthi, Danang Boro (bajilek sibuk aja, tetep semangat), Demang (yem mumet nggarap skripsi ngombe obat wae), Ade (makasih dukungan dan bahan komprenya), Vita, Lisa, Titik, Ari, Rudi, dll (semangat terus agar cepat wisuda)
10. Wendy n Gempar (he..kalian kalau ngomong pakai bahasa gombong lucu), Fika (Thank's b4 (motomu) data inflasi dunianya), Hendy (pak de, kapan pendadaran? Spirit!), Rudi (matur nuwun bosss brg2 piknya) Noli, Uum (mbok yo aku didoakan agar cepat lulus).
11. Temenku yang awet dan mau meneruti perintahku terus: sgh x-430i, t 190, Pentium tuaku dan E1091D132719 (g peduli panas ato hujan).

12. Teman-teman penulis angkatan 2003 khususnya kelas C dan kelas D.
13. Semua pihak yang telah membantu dan memberi dorongan yang penting bagi penulis ngapunten banget tidak bisa menyebutkan satu persatu.

Akhirnya semua kebenaran yang terkandung dalam karya ini berkat petunjuk dari Allah SWT dalam menuntun untuk mendekati kebenaran dan keberhasilan. Semoga Allah SWT senantiasa melimpahkan hidayah-Nya kepada kita semua. Semoga kita diciptakan di dunia ini bisa berbuat sesuatu yang bermanfaat bagi agama, orang tua, lingkungan serta bangsa dan negara kita. Sebagai manusi yang penuh dengan keterbatasan, penulis menyadari bahwa skripsi ini masih jauh mendekati sempurna hingga didalamnya ditemui banyak berbagai kelemahan dan kekurangan baik isi maupun teknik penulisan, sehubungan dengan hal itu makan saran-saran dari berbagai pihak untuk perbaikan dan kesempurnaan skripsi ini akan penulis terima dengan senang hati.

Akhirnya penulis berharap karya ini dapat bermanfaat bagi semua saja yang membutuhkan kelak.

Wassalamualaikum Wr.Wb.

Surakarta, 2007

Penulis

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN MOTTO	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
ABSTRAKSI	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Perumusan Masalah	4
C. Tujuan Penelitian	4
D. Manfaat Penelitian	4
E. Metode Penelitian	5
F. Sistematika Penulisan	10
BAB II LANDASAN TEORI	11
A. Harga Minyak Dunia	11
1. Dasar Pembentukan Harga Minyak	13
2. Faktor noa Teknis yang Menyebabkan Harga Minyak	20
3. Agen Pelaporan Harga Minyak	21
4. Pasar Minyak Dunia	22

B. Inflasi Dunia	26
1. Pengertian Inflasi Dunia	26
2. Dampak Kenaikkan BBM terhadap Inflasi	26
C. Penelitian Terdahulu	28
D. Hipotesis	29
BAB III METODE PENELITIAN	30
A. Jenis dan Sumber Data	30
B. Definisi Operasional Variabel Penelitian	30
1. Harga Minyak Dunia	30
2. Inflasi Dunia	30
C. Alat dan Model Analisis	31
D. Metode Analisis Data	32
1. Uji Stasioneritas Data	32
2. Uji Kointegrasi	33
3. Kausalitas dan <i>Error Corection Model</i> (ECM)	34
4. Uji Asumsi Klasik	37
a. Multikolinieritas	37
b. Heteroskedastisitas	38
c. Autokorelasi	39
d. Normalitas	40
e. Spesifikasi Model	41
5. Uji Statistik	43
a. Validitas Pengaruh	43

b. Keباikkan Model	45
BAB IV GAMBARAN UMUM DAN ANALISIS DATA	48
A. Gambaran Umum	48
1. Perkembangan Minyak Dunia	48
2. Perkembangan Inflasi Dunia	50
B. Hasil Analisis Data	51
1. Uji Stasioneritas	52
2. Uji Kausalitas Model ECM 1	55
3. Uji Uji Asumsi klasik ECM1	57
4. Uji Statistik ECM1	61
5. Uji Kausalitas ECM 2	64
6. Uji Uji Asumsi klasik ECM2	66
7. Uji Statistik ECM2	70
BAB V PENUTUP	76
A. Simpulan	76
B. Saran-saran	77
DAFTAR PUSTAKA	79
LAMPIRAN	81

DAFTAR TABEL

TABEL	HALAMAN
1.1 Perubahan Harga Minyak Dunia	3
4.1 Perkembangan Harga Minyak Dunia	49
4.2 Perkebangan Inflasi Dunia	51
4.3 Hasil Uji ADF Variabel Harga Minyak Dunia	53
4.4 Hasil Uji ADF inflasi Dunia	54
4.5 Hasil Kausalitas Model ECM1	55
4.6 Koefisien Regresi Jangka Panjang ECM1	56
4.7 Hasil Uji Multikolinieritas ECM1	57
4.8 Hasil Uji Spesifikasi Model ECM1	61
4.9 Hasil Kausalitas Model ECM2	64
4.10 Koefisien Regresi Jangka Panjang ECM2	65
4.11 Hasil Uji Multikolinieritas ECM2	66
4.12 Hasil Uji Spesifikasi Model ECM2	70
4.13 Koefisien Regresi Jangka Pendek dan Jangka Panjang ECM2	74
4.14 Koefisien Regresi Jangka Pendek dan Jangka Panjang ECM2	74

DAFTAR GAMBAR

GAMBAR	HALAMAN
3.1 Derah Kritis Uji t	44
3.2 Derah Kritis Uji F	46
4.1 Derah Kritis Heteroskedastisitas (uji White)	58
4.2 Uji t Variabel Inflasi Dunia	62
4.3 Uji t Variabel Inflasi Dunia Tahun Sebelumnya	63
4.4 Uji t Variabel ECT1	63
4.5 Derah Kritis Heteroskedastisitas (uji White)	67
4.6 Uji t Variabel Inflasi Dunia	71
4.7 Uji t Variabel Inflasi Dunia Tahun Sebelumnya	72
4.8 Uji t Variabel ECT2	72

ABSTRAKSI

Penelitian ini berjudul “Analisis Kausalitas Harga Minyak Dunia dengan Inflasi Dunia Tahun 1980-2005”. Adapun tujuannya adalah untuk mengetahui pola arah kausalitas harga minyak dunia dengan inflasi dunia tahun 1980-2005 dalam jangka pendek maupun dalam jangka panjang. Variabel yang digunakan dalam penelitian ini adalah harga minyak dunia dan inflasi dunia. Sedangkan alat analisis yang digunakan adalah model kausalitas ECM atau koreksi kesalahan.

Dari hasil uji kausalitas ECM (*Error Correction Model*) diketahui bahwa antara harga minyak dunia dengan inflasi dunia terjadi hubungan satu arah yaitu inflasi dunia berpengaruh terhadap harga minyak dunia. Hal ini ditunjukkan bahwa pada model ECM 1 nilai probabilitas ECT 1 sebesar 0,9023 lebih besar dari $\alpha = 10\%$ dan pada ECM 2 nilai probabilitas pada ECT2 sebesar 0,0001 lebih kecil $\alpha = 10\%$. Berdasarkan hasil uji aumsi klasik, pada model ECM1 terdapat masalah multikolinieritas. Koefisien determinasi (R^2) pada model ECM 2 (R^2) adalah 0,763155. Jadi koefisien determinasi menunjukkan bahwa 76,3155% variasi dari variabel inflasi dunia dijelaskan oleh variabel harga minyak dunia sedangkan sisanya yaitu 23,6845% dijelaskan oleh variabel-variabel bebas lain diluar model yang diteliti

Pembimbing

(Eny Setyowati,SE)

Mengetahui
Dekan Fakultas Ekonomi
Muhammadiyah Surakarta

(Drs.H.Syamsudin,MM)