

**ANALISIS KAUSALITAS GRANGER ANTARA TABUNGAN DOMESTIK
DENGAN PERTUMBUHAN EKONOMI
(TAHUN 1978 - 2003)**



SKRIPSI

Diajukan untuk Memenuhi Tugas dan Syarat-syarat
Guna Memperoleh Gelar Sarjana Ekonomi Jurusan
Studi Pembangunan pada Fakultas Ekonomi
Universitas Muhammadiyah Surakarta

Oleh :

WAWAN SUBIYANTO

B 300 010 147

**FAKULTAS EKONOMI
UNIVERSITAS MUHAMMADIYAH SURAKARTA**

2006

PENGESAHAN

Yang bertanda tangan di bawah ini telah membaca skripsi dengan judul:

**“ANALISIS KAUSALITAS GRANGER ANTARA TABUNGAN DOMESTIK
DENGAN PERTUMBUHAN EKONOMI TAHUN 1978-2003”**

Yang ditulis oleh:

WAWAN SUBIYANTO

NIM. B 300 010 147

Penandatanganan berpendapat bahwa skripsi tersebut telah memenuhi syarat untuk diterima.

Surakarta, 2006
Pembimbing I

(Siti Fatimah, SE, M.Si)

Mengetahui
Dekan Fakultas Ekonomi

(Drs. H. Syamsudin, MM.)

MOTTO

Janganlah kalian putus asa dan bersedih dan kalian akan senantiasa menang apabila kalian beriman.

(QS. Ali Imran [3] ayat 139)

Sesungguhnya sesudah kesulitan akan datang kemudahan. Maka kerjakanlah urusanmu dengan sungguh-sungguh, dan hanya kepada ALLAH kamu berharap.

(QS. Alam Nasyrah : 6-8)

"Tidaklah ALLAH SWT membebani seseorang melainkan sesuai dengan kesanggupannya".

(QS. Al-Baqarah:256)

Berjumpa dengan manusia tidak memberi manfaat apa-apa,
Kecuali perkataan yang sia-sia dan kabar angin.
Maka kurangilah bertemu dengan manusia,
Kecuali untuk mengambil ilmu atau memperbaiki diri.

(Sya'ir)

Ketika kehidupan sudah tidak lagi bermakna, semua terasa sia-sia. Hampa dan terasing di alam yang fana. Maka takut dan berserah dirilah kepada yang menciptakan kamu sekalian. Jadikan kekalahan dan kelemahan sebagai semangat untuk menuju keberhasilan dengan talenta yang melekat pada diri kalian.

(Penulis)

PERSEMBAHAN

Karya kecil ini kupersembahkan untuk:

- ❖ Ayah (alm) dan Bunda tercinta atas kasih sayang yang berlimpah.
- ❖ Segenap keluarga yang selalu membimbing, mendukung dan mendoakan.
- ❖ Sahabat-sahabat ku dimanapun kalian berada.
- ❖ Tak lupa bagi pembaca yang budiman.

KATA PENGANTAR

Assalamu'alaikum Wr.Wb.

Alhamdulillah puji syukur kehadirat Allah SWT atas berkah, rahmat dan hidayah-Nya yang telah melimpahkan kepada penulis, sehingga penulis dapat menyelesaikan penyusunan skripsi ini sebagai syarat untuk memperoleh gelar sarjana ekonomi pada Fakultas Ekonomi Universitas Muhammadiyah Surakarta. Dalam penelitian ini, penulis mengambil judul : “Analisis Kausalitas Granger antara Tabungan Domestik dengan Pertumbuhan Ekonomi Tahun 1978-2003”.

Pada kesempatan ini, penulis ingin menyampaikan rasa terimakasih yang tulus dan penghargaan yang setinggi-tingginya kepada semua pihak yang telah membantu baik secara langsung maupun tidak langsung hingga selesainya skripsi ini.

Ucapan terimakasih dan penghargaan yang tulus penulis haturkan kepada:

1. Ibu Siti Fatimah, SE,M.Si, selaku Pembimbing Utama yang sudah dengan arif dan bijaksana dalam memberikan bimbingan dan petunjuk untuk penyusunan skripsi ini.
2. Bapak Drs. Wahyono, AK,MA, selaku Dekan Fakultas Ekonomi.
3. Bapak Drs. Yuni Prihadi Utomo, selaku Kepala Jurusan IESP sekaligus Pembimbing Akademik yang selama ini selalu memberikan arahan-arahan dengan sabar dan bijak.
4. Bapak dan Ibu Dosen Fakultas Ekonomi Universitas Muhammadiyah Surakarta, yang telah memberikan bekal ilmu selama penulis menempuh studi.
5. Bapak Mardani, yang selalu arif dan bijaksana serta sabar dalam melayani penulis selama menempuh studi.
6. Pihak-pihak lain yang tidak bisa penulis sebutkan satu persatu, karena dengan bantuannya skripsi ini dapat selesai.

7. Bunda tercinta dan segenap keluarga di rumah yang selalu mendo'akan, mendukung dan mencurahkan kasih sayangnya kepada penulis.
8. Sahabat sejawatku SMAPANG (Agus, Wa'O, Sutoyo, Ali, Hartoyo, Syehudin, Tahyudin, Firman, Wondo, Ikhwan, Iwan, Nardi, Basir), semangat dan canda kalian akan selalu dalam kehidupanku.
9. Sahabat-sahabat di perantauan (Eko, Daryanto, Sartono, Budi, Arma, Ari, Rahmawati Ragil, Silvi, Sri Mulyani, Erga, Basuki, Heri, O'Men), terimakasih atas segala dukungan, pertolongan, pengorbanan, kekeluargaan dan keceariannya yang selalu menemani hingga penulis bisa menyelesaikan skripsi ini.
10. Sahabat IESP semua kelas, terkhusus kelas C angkatan 2001 yang tidak bisa penulis sebutkan satu-satu.
11. Mas Suyatno atas olah datanya.
12. Semua teman kost, dimana aku pernah tinggal.

Sripsi ini tidak akan selesai jika menunggu hasil yang sempurna. Besar harapan penulis dengan skripsi ini dapat bermanfaat untuk menambah khasanah keilmuan yang ada. Saran dan kritik yang membangun sangat diharapkan guna mendapatkan hasil penelitian yang lebih baik lagi. Penulis minta maaf atas segala kekurangan dan ucapan terimakasih kepada para pembaca yang budiman atas perhatiannya.

Akhirnya penulis hanya mampu berdo'a kepada Allah SWT agar selalu melimpahkan berkah dan rahmat-Nya kepada kita semua. Amin.

Wassalamu alaikum Wr.Wb.

Surakarta, 2005

Penulis

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN ABSTRAKSI	ii
HALAMAN PENGESAHAN	iii
HALAMAN MOTTO	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN	v
KATA PENGATAR	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xi
BAB I. PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang	1
B. Perumusan Masalah	3
C. Tujuan Penelitian	3
D. Manfaat Penelitian	4
E. Metode Penelitian	4
F. Sistematika Penulisan	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	7
A. Definisi Pertumbuhan	7
B. Teori Pertumbuhan	9
C. Definisi Tabungan	17

	D. Hubungan antara Tabungan dan Pertumbuhan Ekonomi ..	21
	E. Penelitian Terdahulu	22
	F. Hipotesis	22
BAB III	METODE PENELITIAN	23
	A. Objek Penelitian	23
	B. Jenis dan Sumber Data	23
	C. Definisi Operasional Variabel dan Pengukuran	23
	D. Metode Analisis Data	24
BAB IV	HASIL PENELITIAN	32
	A. Gambaran Umum Data	32
	1. Perkembangan Tabungan Domestik	32
	2. Perkembangan Pertumbuhan Ekonomi	34
	B. Analisis Hasil Regresi	36
	1. Analisis Regresi	36
	2. Uji Kausalitas Granger	39
BAB V	PENUTUP	42
	A. Simpulan	42
	B. Saran	43

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

DAFTAR TABEL

	Halaman
Table 4.1 Tabungan Masyarakat dan Tabungan Pemerintah	33
Table 4.2 Produk Domestik Bruto (PDB) dan Pertumbuhan Ekonomi	36
Table 4.3 Hasil Uji DF Pertumbuhan Ekonomi	37
Table 4.4 Hasil Uji ADF Pertumbuhan Ekonomi	38
Table 4.5 Hasil Uji DF Tabungan Domestik	38
Table 4.6 Hasil Uji ADF Tabungan Domestik	39
Table 4.7 Hasil Uji Kausalitas Granger Tabungan Domestik dan Pertumbuhan Ekonomi	40

DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 2.1 Fungsi Produksi Neo Klasik	13
Gambar 2.2 Fungsi Produksi Harrod-Domar	15

ABSTRAKSI

Penelitian ini berjudul “Analisis Kausalitas Granger antara Tabungan Domestik dengan Pertumbuhan Ekonomi Tahun 1978-2003”. Tujuan penelitian ini untuk mengetahui pola hubungan kausalitas antara tabungan domestik dengan pertumbuhan ekonomi di Indonesia selama periode yang diamati.

Metode analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah metode Granger. Hasil estimasi dengan menggunakan metode ini menunjukkan bahwa hasil uji stasioneritas dengan menggunakan uji *Dickey Fuller* (DF) dan uji *Augmented dickey Fuller* (ADF) pada variabel pertumbuhan ekonomi sudah stasioner. Hal ini bisa dilihat pada uji DF nilainya 4,321945 lebih besar dari nilai kritis *Mackinom* 1% sebesar 3,7204, sedangkan pada uji ADF nilainya 3,336876 lebih besar dari nilai kritis *Mackinom* 5% sebesar 2,9969. Untuk variabel tabungan domestik dengan menggunakan uji DF tidak stasioner karena nilai DF lebih kecil dari nilai kritis *Mackinomnya*. Sedangkan pada uji ADF sudah stasioner, karena pada uji ADF nilainya 3,058884 lebih besar dari nilai kritis *Mackinom* 5% sebesar 3,0038. Karena variabel tabungan domestik dan variabel pertumbuhan ekonomi sudah stasioner, maka uji kointegrasi tidak perlu dilakukan.

Dalam uji kausalitas Granger antara tabungan domestik dengan pertumbuhan ekonomi, dapat diketahui bahwa pada lag 1 sampai dengan lag 6 menunjukkan hubungan kausalitas satu arah pada $\alpha = 5\%$ yaitu hipotesis nol untuk pertumbuhan ekonomi (Y) tidak mempengaruhi tabungan domestik (S), ditolak. Artinya, pertumbuhan ekonomi mempengaruhi tabungan domestik.

Kata kunci: *Tabungan Domestik, Pertumbuhan Ekonomi (PDB), Uji Stasioneritas, Uji Kausalitas Granger.*

Surakarta, 2005

Pembimbing Utama

(Siti Fatimah SE, M.Si.)

Mengetahui

Dekan Fakultas Ekonomi

(Drs. H. Syamsudin, MM.)