

Faktor-faktor yang mempengaruhi permintaan uang (broad money) di Indonesia (periode data Q1.2000 - Q3.2011) = The Determinants of demand for money (broad money) in Indonesia (Data period of Q1.2000 - Q3.2011)

Andri Kurniawan, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20296610&lokasi=lokal>

Abstrak

Tesis ini berisikan kajian mengenai faktor-faktor yang mempengaruhi permintaan uang dalam perekonomian Indonesia, khususnya uang dalam arti luas (M2) dalam periode data triwulan satu tahun 2000 sampai triwulan tiga tahun 2011. Analisis menggunakan modifikasi model G.S. Laumas dan J.S. Fackler (1987), dan Andreas Beyer (1998). Variabel yang digunakan dalam tulisan ini adalah uang beredar dalam arti luas (M2), Produk domestik bruto (PDB riil), inflasi, tingkat bunga dan nilai tukar (kurs). Data diolah dengan menggunakan model Ordinary Last Squares (OLS). Data yang digunakan adalah data time series dari publikasi Bank Indonesia dan Badan Pusat Statistik (BPS). Hasil pengolahan menunjukkan data yang dianalisis bersifat non-stasioner. Dengan menggunakan metode OLS disertai variabel ARMA (autoregressive dan moving average), dalam pengolahan model dijumpai hubungan yang signifikan antara perubahan faktor-faktor (determinan) yang digunakan terhadap pertumbuhan permintaan uang (M2) di Indonesia.

<hr>

This thesis contains a study to examine the determinants of demand for money (broad money ? M2) growth in Indonesia, using data period from Q1.2000 to Q3.2011. The model analysis is based on modified model from GS Laumas and J.S. Fackler (1987) and Andreas Beyer (1998). The variables used are broad money (M2), gross domestic product (real GDP), inflation, interest rates, and exchange rates. Method of analysis is Ordinary Last Squares (OLS). Data used are quarterly time series from publications of Bank Indonesia and Badan Pusat Statistik (BPS). The data showed a non-stationary result. By using the method of OLS and variables of ARMA (autoregressive and moving average), the findings showed a significant relationship between all determinants on the growth of demand for broad money (M2) in Indonesian economy.