

ABSTRAKSI

Skripsi ini berjudul "*Analisis pengaruh tingkat suku bunga dan kredit likuiditas Bank Indonesia terhadap nilai transaksi pasar uang antarbank di Indonesia kurun waktu 1975-2004*". Pencatatan terhadap perkembangan nilai transaksi pasar uang antarbank perlu dilakukan untuk mengetahui posisi permintaan dan penawaran dana yang terjadi di pasar keuangan yang terdiri dari berbagai macam surat surat berharga. Nilai transaksi pasar uang antarbank dalam penelitian hampir selalu mengalami peningkatan dari tahun ke tahun, hal ini membuktikan bahwa dalam memenuhi kesulitan dana, para pelaku ekonomi seperti perbankan dan para investor begitu membutuhkan pasar uang. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui seberapa besar pengaruh tingkat suku bunga pasar uang dan kredit likuiditas Bank Indonesia terhadap nilai transaksi pasar uang antarbank di Indonesia. Adapun referensi yang dijadikan sumber informasi mengenai variabel-variabel yang terdapat dalam penelitian adalah Bank Indonesia, Biro Pusat Statistik, buku-buku literatur, serta sumber lain yang berkaitan dengan penelitian.

Penelitian ini menggunakan alat analisis berupa regresi dengan aplikasi model PAM (*parsial adjustment model*) yaitu model regresi yang dengan memasukkan nilai *lag* (selang waktu) variabel tak bebas diantara variabel yang menjelaskan. Dengan menggunakan Uji Asumsi Klasik dapat diambil kesimpulan bahwa model regresi yang dipakai dalam penelitian ini terhindar dari permasalahan autokorelasi, heteroskedastisitas, dan multikolinearitas. Untuk mengetahui pengaruh variabel bebas terhadap variabel tak bebas dengan menggunakan Uji Statistik, diperoleh hasil yang menunjukkan nilai; constant (-0,723), SBAB (- 0,025), KLBI (0.273) dan PUAB_{t-1} (0,868). Uji-t menunjukkan hasil bahwa secara individual variabel bebas berpengaruh secara signifikan terhadap variabel tak bebas, dengan derajat kepercayaan; SBAB dan KLBI masing-masing sebesar 5% dan untuk PUAB_{t-1} sebesar 1%. Uji F menunjukkan angka yang signifikan yaitu sebesar 259,381 dengan taraf signifikan 95%. Uji R juga mendukung penelitian ini, dimana 96,9% keragaman nilai variabel tidak bebas