

INTISARI
ANALISIS DAMPAK INDEKS HARGA KONSUMEN DAN TABUNGAN
DOMESTIK BRUTO TERHADAP PRODUK DOMESTIK BRUTO
MENGGUNAKAN METODE
VECTOR ERROR CORRECTION MODEL (VECM)

(Studi Kasus: Indonesia Periode 1968 - 2018)

Rizka Khairunnisa

Program Studi Statistika, Fakultas Matematika dan Ilmu Pengetahuan Alam

Universitas Islam Indonesia

Produk Domestik Bruto atau PDB merupakan nilai pasar semua barang/jasa akhir yang diproduksi dalam suatu negara selama satu periode atau satu tahun. Meskipun banyak faktor yang mempengaruhi PDB, namun penelitian ini berfokus pada Indeks Harga Konsumen (IHK) dan Tabungan Domestik Bruto (TDB) di Indonesia. Tujuan utama dari penelitian ini adalah untuk melihat hubungan kausalitas dan dampak dari IHK dan TDB terhadap PDB dari tahun 1968 hingga 2018. Penelitian ini juga berfokus pada penggunaan VECM yang merupakan bentuk model *Vector Autoregressive (VAR)* yang terestriksi. Restriksi ini diberikan akibat dari permasalahan data yang tidak stasioner, tetapi mempunyai hubungan jangka panjang (kointegrasi). Uji stasioneritas dan kointegrasi ini sebagai langkah awal dalam mengantisipasi terdapatnya regresi palsu sehingga data yang akan dianalisis tidak akan memberikan informasi yang menyesatkan. Berdasarkan hasil penelitian, data ditemukan tidak stasioner lalu dilakukan *first differencing* pada data tersebut. Setelah data stasioner dan ditemukan bahwa terdapat kointegrasi, maka asumsi analisis VECM terpenuhi. Namun, pada analisis VECM ditemukan bahwa tidak terdapat hubungan jangka panjang yang signifikan secara statistik antar variabel, hanya terdapat hubungan jangka pendek dari variabel IHK terhadap PDB dan tidak terdapat hubungan jangka pendek dari TDB ke PDB. Sementara itu, berdasarkan hasil uji kausalitas berpasangan ditemukan bahwa IHK mempengaruhi PDB, namun tidak sebaliknya, serta ditemukan pula bahwa TDB tidak mempengaruhi PDB, namun sebaliknya. Adapun dari hasil *analisis Impulse Response Function (IRF)* dan *Variance Decomposition (VD)* diperoleh hasil bahwa IHK cenderung memiliki dampak yang cukup signifikan terhadap PDB, sedangkan TDB tidak cukup berpengaruh terhadap peningkatan nilai PDB.

Kata Kunci: PDB, IHK, TDB, Kausalitas, VAR, *Vector Error Correction Model (VECM)*