

PENERAPAN MODEL *VECTOR AUTOREGRESIF (VAR)*

(Studi Kasus: Interaksi Kebijakan Fiskal dan Moneter di Indonesia dengan Menggunakan Data Tahunan 2000 sampai 2015)

Oleh : Rizka Aditya Diah Syafiah

Program Studi Statistika Fakultas MIPA

Universitas Islam Indonesia

INTISARI

Pada era globalisasi seperti ini perkembangan perekonomian semakin dinamis dan terintegrasi dengan perekonomian dunia. Hal ini memberikan implikasi penting bagi para pelaku ekonomi terutama dalam pengambilan keputusan berkaitan dengan kebijakan perekonomian. Aplikasi model *Vector Autoregression (VAR)* merupakan salah satu model yang digunakan untuk menentukan peramalan, dan dikaitkan dalam perekonomian salah satunya pengambilan kebijakan makroekonomi. Pada dasarnya Model VAR digunakan untuk menjelaskan perilaku dinamis antar variabel yang diamati dan saling mempunyai keterkaitan dan akan diuraikan lebih lanjut melalui fungsi propertinya yaitu fungsi *Impulse Response* dan *Variance Decomposition*. Oleh karena itu model *Vector Autoregression (VAR)* menjadi salah satu alternatif untuk pemecahan permasalahan dengan mencari faktor-faktor yang berpengaruh dalam kebijakan fiskal dan moneter. Berdasarkan uraian di atas berkaitan dengan alasan peneliti memilih tema Model *Vector Autoregression (VAR)* untuk memahami bentuk model Model *Vector Autoregression (VAR)* beserta penerapannya khususnya berkaitan dengan bidang perekonomian. Oleh karena itu peneliti ingin membahas lebih dalam berkaitan dengan polemik tersebut dengan judul penelitian “ Model *Vector Autoregressive (VAR)* dan Penerapannya yang diterapkan dalam Studi Kasus Interaksi Kebijakan Fiskal dan Moneter di Indonesia”. Berdasarkan hasil analisis kualitas dalam penelitian, dapat dijelaskan bahwa variabel fundamental makroekonomi tingkat inflasi dan PDB/GDP tidak memberikan pengaruh terhadap interaksi kebijakan fiskal dan moneter yang searah.

Kata Kunci : VAR, *Impulse Response*, *Variance Decomposition*, *Time Series*