

ABSTRAK

ANALISIS VECTOR ERROR CORRECTION MODEL (VECM) TERHADAP DATA KURS, BI RATE DAN INFLASI DI INDONESIA PADA BULAN JULI 2005 – JULI 2016

Oleh

CITRA ALAM PUSPITA

Pada umumnya model ekonometrika *time series* merupakan model struktural karena didasarkan atas teori ekonomi yang telah ada. Model VAR merupakan model non struktural karena bersifat a teori. VECM berbeda dengan VAR dimana VECM dapat digunakan untuk memodelkan data *time series* yang terkointegrasi dan tidak stasioner. Tujuan dari penelitian ini adalah untuk menganalisis data *time series* dengan menggunakan VECM pada data kurs BI rate, dan inflasi di Indonesia pada bulan Juli 2005 hingga Juli 2016. Model yang diperoleh untuk data tersebut adalah model VEC(3,1).

Kata Kunci : Stasioner, Kointegrasi, VAR, VECM

ABSTRACT

ANALYSIS VECTOR ERROR CORRECTION MODEL (VECM) ON DATA RATE OF EXCHANGE, BI RATE DAN INFLATION IN INDONESIA ON JULY 2005 – JULY 2016

By

CITRA ALAM PUSPITA

Generally econometrics model time series is structural model because base on previously teory. VAR model is not structural model because atheory. VECM different with VAR which is VECM can use for modeling cointegration time series data and not stasioner. This research for analysis time series data using VECM on data rate of exchange, BI Rate and Inflation in Indonesia on July 2005 until July 2016. Result of model for the data is VECM(3,1).

Keywords : Stasioner, Cointegration, VAR, VECM