

## **ABSTRACT**

### **VECTOR ERROR CORRECTION MODEL TO ANALYZE DATA ON THE MONEY SUPPLY AGAINST IMPORTS IN INDONESIA**

**By**

**NADIA VIVO MAULINDA**

The economic development of a country is influenced by investment, international trade, the money supply, interest rates and human resources. Money supply and import data is one example of time series data. The Vector Error Correction Model (VECM) method is one of the multivariate time series methods for data that is not stationary and has co-integration. This study will analyze the influence of time series data using the Vector Error Correction Model on money supply data and import data in Indonesia in January 2003 – July 2021 with the help of R-Studio software. The analysis resulted in modeling of broad money supply and currency against imports from January 2003 to July 2021 using VECM. Then we obtained the VECM model(2).

**Keywords: Money Supply, Cointegration, VECM**

## **ABSTRAK**

### ***VECTOR ERROR CORRECTION MODEL* UNTUK MENGANALISIS DATA JUMLAH UANG BEREDAR TERHADAP IMPOR DI INDONESIA**

**Oleh**

**NADIA VIVO MAULINDA**

Perkembangan ekonomi suatu negara juga dipengaruhi oleh, investasi, perdagangan internasional, jumlah uang beredar, tingkat suku bunga dan sumber daya manusia. Data jumlah uang beredar dan impor merupakan salah satu contoh data deret waktu. Metode *Vector Error Correction Model* (VECM) merupakan salah satu metode *multivariate time series* untuk data yang tidak stasioner dan memiliki kointegrasi. Penelitian ini akan menganalisis pengaruh data deret waktu menggunakan model *Vector Error Correction Model* pada data jumlah uang beredar dan data impor di Indonesia pada bulan Januari 2003 hingga Juli 2021 dengan bantuan *software R-Studio*. Analisa menghasilkan pemodelan uang beredar luas dan uang kartal terhadap impor dari bulan Januari 2003 hingga Juli 2021 menggunakan VECM. Kemudian diperoleh model VECM(2).

**Kata Kunci: Jumlah Uang Beredar, Kointegrasi, VECM**