

ABSTRAK

Assyiffa Fauziyyah Lathiffah (14310004)

PENERAPAN MODEL VAR (*VECTOR AUTOREGRESSION*) UNTUK MENGETAHUI PENGARUH NILAI TUKAR TERHADAP INFLASI DI INDONESIA

Penelitian ini bertujuan membentuk model *Vector Autoregressive* (VAR) untuk mengetahui pengaruh pergerakan nilai tukar terhadap inflasi di Indonesia. Penelitian ini mengambil data Indeks Harga Barang Impor (IMP), Indeks Harga Perdagangan Besar (IHPB), Indeks Harga Konsumen (IHK), Harga Minyak Dunia (OIL) dan Nilai Tukar Rupiah (ER).

Pembentukan model *VAR* melalui beberapa tahap yaitu: uji stasioneritas, penentuan panjang lag optimal, pembentukan model *VAR*. Uji stasioneritas dalam *VAR* menggunakan uji akar-akar unit (*unit root test*) dengan metode *Augmented Dickey Fuller Test (ADF Test)*. Penentuan panjang lag optimal dilihat dari nilai *Akaike Information Criteria (AIC)* yang paling minimum. Selanjutnya untuk menganalisis model digunakan *Impulse Response* dan *Variance Decomposition*.

Pada estimasi model VAR menggunakan *impulse response function* dapat menunjukkan bahwa importir dan produsen domestik memiliki reaksi pada jangka pendek dalam menyesuaikan harga barang. Melalui analisis *variance decomposition* menunjukkan *shock* perubahan nilai tukar memiliki kontribusi yang besar pada tingkat harga pada indeks harga barang impor dan IHPB yang memiliki kecenderungan menurun pada periode selanjutnya.

Kata kunci : *vector autoregression, nilai tukar, inflasi.*