

Analisis hubungan antara inflasi dan pertumbuhan ekonomi di Indonesia menggunakan pendekatan kointegrasi dan kausalitas Granger pada periode 2000-2012 = Analysis of relationship between inflation and economic growth in Indonesia using cointegration and Granger causality approach for 2000-2012 period

Dina Acyuninda, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20345879&lokasi=lokal>

Abstrak

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis hubungan yang terjadi antara inflasi dan pertumbuhan ekonomi di Indonesia. Penelitian ini memiliki cakupan data Indeks Harga Konsumen dan Produk Domestik Bruto periode 2000:2012. Uji stasioneritas data dilakukan dengan menggunakan Augmented Dickey-Fuller (ADF) test dan Phillips-Perron (PP) test, dan ditemukan bahwa data stasioner pada first difference. Bounds test dilakukan untuk menguji ada atau tidak hubungan kointegrasi diantara variabel, dimana hasil menunjukkan bahwa tidak ada hubungan kointegrasi. Pengujian kausalitas Granger antara inflasi dan pertumbuhan ekonomi dilakukan dengan menggunakan uji yang dikembangkan oleh Toda-Yamamoto (1995). Hasilnya adalah tidak ditemukan hubungan kausalitas yang terjadi dari pertumbuhan ekonomi terhadap inflasi, melainkan hubungan kausalitas yang ditemukan terjadi dari inflasi terhadap pertumbuhan ekonomi. Hasil pengujian tersebut menunjukkan bahwa variabel inflasi memiliki pengaruh terhadap pertumbuhan ekonomi.The purpose of this research is to analyze the relationship between inflation and economic growth in Indonesia. The data covered in this research is Consumer Price Index (CPI) and Gross Domestic Product (GDP) of 2000-2012 period. Stationarity test was carried out using the Augmented Dickey-Fuller (ADF) and Phillip-Perron test (PP), and found that the data is stasioner at first difference. The bounds test was carried out to find the existance of cointegration between variables, the result is no cointegration between inflation and economic growth in Indonesia. Granger causality test employed using Toda-Yamamoto Approach (1995), where there is no significant result of causality running from economic growth to inflation, but the significant result was found running from inflation to economic growth. The test is stated that inflation has impact on economic growth.