

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
LEMBAR PENGESAHAN.....	ii
LEMBAR PERNYATAAN PEMBIMBING.....	iii
LEMBAR PERNYATAAN KEASLIAN	i
KATA PENGANTAR	ii
DAFTAR ISI	iv
DAFTAR TABEL	vii
DAFTAR GAMBAR.....	viii
DAFTAR LAMPIRAN.....	ix
ABSTRAKSI.....	xi
ABSTRACT	xii
BAB I.....	1
PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Permasalahan Penelitian	6
1.3 Pertanyaan Penelitian.....	7
1.4 Tujuan Penelitian.....	7
1.5 Manfaat Penelitian.....	8
1.6 Sistematika Penulisan	9
BAB II.....	11
TINJAUAN PUSTAKA	11
2.1 Landasan Teori.....	11
2.1.1 Inflasi.....	11
2.1.2 Macam-macam Inflasi.....	12
2.1.3 Teori Inflasi	13
2.1.4 Sumber Inflasi.....	16
2.1.5 Penghitungan Inflasi.....	19
2.1.6 Dampak Inflasi.....	22
2.1.7 Hubungan antara <i>Budget Deficit</i> dan Inflasi.....	25

2.1.8 Hubungan antara <i>BI rate</i> dan Inflasi.....	27
2.1.9 Hubungan antara <i>Exchange Rate</i> dan Inflasi.....	28
2.1.10 Hubungan antara <i>Expected Inflation</i> dan Inflasi.....	29
2.1.11 Hubungan antara Jumlah Uang Beredar dan Inflasi.....	30
2.1.12 Hubungan antara <i>Oil Price</i> dan Inflasi.....	30
2.1.13 Hubungan antara PDB dan Inflasi.....	31
2.1.14 Hubungan antara <i>Wage</i> dan Inflasi	32
2.2 Tinjauan Studi Terdahulu	33
BAB III	39
METODE PENELITIAN.....	39
3.1 Jenis dan Sumber Data.....	39
3.2 Model Penelitian	40
3.3 Metode Analisis.....	42
3.3.1 Uji Stasioneritas.....	43
3.2.2 Pemeriksaan <i>Lag Optimal</i>	47
3.2.3 Uji Kointegrasi.....	48
3.2.4 Metode Vector Autoregressive (VAR).....	48
3.2.5 Metode Vector Error Correction Model (VECM).....	51
3.2.7 Pemanfaatan Sistem VAR dan VECM.....	54
BAB IV	56
ANALISIS DAN PEMBAHASAN	56
4.1 Gambaran Umum Variabel Penelitian.....	56
4.1.1 Perkembangan Inflasi	56
4.1.2 Perkembangan <i>Budget Deficit</i>	58
4.1.3 Perkembangan <i>BI rate</i>	59
4.1.4 Perkembangan <i>Exchange Rate</i>	61
4.1.5 Perkembangan Ekspektasi Inflasi.....	62
4.1.6 Perkembangan Jumlah Uang Beredar.....	63
4.1.7 Perkembangan <i>Oil Price</i>	64
4.1.8 Perkembangan PDB.....	66
4.1.9 Perkembangan <i>Wage</i>	67
4.2 Hasil dan Analisis Statistik	68
4.2.1 Uji Stasioneritas	68

4.2.2 Uji Lag Optimal.....	70
4.2.3 Uji Stabilitas VAR.....	71
4.2.4 Uji Kointegrasi	72
4.2.5 Analisis VECM	75
4.2.6 Analisis Kausalitas dengan Granger Causality	79
4.2.7 Analisis Uji Asumsi Klasik.....	81
4.2.8 Analisis Impulse Response Function.....	84
4.2.9 Analisis Forecast Error Variance Decomposition (FEVDs).....	96
BAB V.....	99
KESIMPULAN DAN SARAN	99
5.1 Kesimpulan	99
5.2 Saran	100
DAFTAR PUSTAKA	102
LAMPIRAN	105

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Ringkasan Penelitian Terdahulu.....	36
Tabel 3.1 Jenis dan Sumber Data.....	39
Tabel 4.1 Hasil Unit Root Test	69
Tabel 4.2 Hasil Uji Lag Optimal.....	70
Tabel 4.3 Hasil Uji Stabilitas VAR.....	71
Tabel 4.4 Hasil Summary Johansen Cointegration Test	73
Tabel 4.5 Hasil Uji Kointegrasi	74
Tabel 4.6 Hasil Uji VECM (Koefisien Jangka Panjang).....	77
Tabel 4.7 Hasil Uji VECM (KoefisienPenyesuaian/ Speed of Adjustment)....	78
Tabel 4.8 Hasil Uji VECM (Koefisien Jangka Pendek).....	78
Tabel 4.9 Hasil Uji Kausalitas dengan Granger Causality Test	80
Tabel 4.10 Hasil Uji Multikolinearitas.....	82
Tabel 4.11 Hasil Uji Heteroskedastisitas.....	83
Tabel 4.12 Hasil Uji Autokorelasi	83

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Inflasi Indonesia Tahun 2006 - 2015	3
Gambar 2.1 Demand Pull Inflation	17
Gambar 2.2 Cost Push Inflation.....	18
Gambar 3.1 Tahap Analisis VECM	43
Gambar 4.1 Perkembangan Inflasi Indonesia Tahun 2006 - 2015.....	57
Gambar 4.2 Perkembangan <i>Budget Deficit</i> Tahun 2006 - 2015	59
Gambar 4.3 <i>BI Rate</i> Indonesia Tahun 2006 - 2015	60
Gambar 4.4 Perkembangan <i>Exchange Rate</i> Indonesia Tahun 2006 - 2015	61
Gambar 4.5 Perkembangan Ekspektasi Inflasi Indonesia Tahun 2006 - 2015 ..	62
Gambar 4.6 Perkembangan Jumlah Uang Beredar Indonesia Tahun 2006 - 2015	64
Gambar 4.7 Perkembangan Harga Minyak Dunia Tahun 2006 - 2015.....	65
Gambar 4.8 Perkembangan PDB Tahun 2006 - 2015	67
Gambar 4.9 Perkembangan Upah Rata-rata Indonesia Tahun 2006 - 2015	68
Gambar 4.10 Hasil Uji Stabilitas VAR dalam <i>Unit Circle</i>	72
Gambar 4.11 Hasil Uji Normalitas.....	84
Gambar 4.12 Respon Inflasi Terhadap Guncangan Inflasi.....	85
Gambar 4.13 Respon Inflasi Terhadap Guncangan <i>Budget Deficit</i>	87
Gambar 4.14 Respon Inflasi Terhadap Guncangan <i>BI Rate</i>	89
Gambar 4.15 Respon Inflasi Terhadap Guncangan <i>Exchange Rate</i>	90
Gambar 4.16 Respon Inflasi Terhadap Guncangan Ekspektasi Inflasi.....	91
Gambar 4.17 Respon Inflasi Terhadap Guncangan Jumlah Uang Beredar.....	93
Gambar 4.18 Respon Inflasi Terhadap Guncangan <i>Oil Price</i>	94
Gambar 4.19 Respon Inflasi Terhadap Guncangan PDB.....	95
Gambar 4.20 Respon Inflasi Terhadap Guncangan <i>Wage</i>	96
Gambar 4.21 Hasil Forecast Error Variance Decomposition	98

DAFTAR LAMPIRAN

L.1 Tabel Data Mentah	105
L.2 Tabel Data Mentah Dalam Log	106
L.3 Hasil Uji Stasioneritas	108
L.3.1 Uji Stasioneritas Inflasi di Tingkat Level	108
L.3.2 Uji Stasioneritas <i>Budget Deficit</i> di Tingkat Level	109
L.3.3 Uji Stasioneritas <i>BI Rate</i> di Tingkat Level	110
L.3.4 Uji Stasioneritas <i>Exchange Rate</i> di Tingkat Level	111
L.3.5 Uji Stasioneritas Ekspektasi Inflasi di Tingkat Level	112
L.3.6 Uji Stasioneritas Jumlah Uang Beredar di Tingkat Level	113
L.3.7 Uji Stasioneritas OILP di Tingkat Level	114
L.3.8 Uji Stasioneritas PDB di Tingkat Level	115
L.3.9 Uji Stasioneritas WAGE di Tingkat Level	116
L.3.10 Uji Stasioneritas Inflasi di Tingkat <i>First Difference</i>	117
L.3.11 Uji Stasioneritas <i>Budget Deficit</i> di Tingkat <i>First Difference</i>	118
L.3.12 Uji Stasioneritas <i>BI Rate</i> di Tingkat <i>First Difference</i>	119
L.3.13 Uji Stasioneritas <i>Exchange Rate</i> di Tingkat <i>First Difference</i>	120
L.3.14 Uji Stasioneritas Ekspektasi Inflasi di Tingkat <i>First Difference</i>	121
L.3.15 Uji Stasioneritas Jumlah Uang Beredar di Tingkat <i>First Difference</i>	122
L.3.16 Uji Stasioneritas OILP di Tingkat <i>First Difference</i>	123
L.3.17 Uji Stasioneritas PDB di Tingkat <i>First Difference</i>	124
L.3.18 Uji Stasioneritas WAGE di Tingkat <i>First Difference</i>	125
L.4 Hasil Uji <i>Lag</i> Optimal	126
L.5 Hasil Uji Stabilitas VAR	126
L.6 Hasil Uji Derajat Kointegrasi	127
L.6.1 Hasil <i>Summary Johansen Cointegration Test</i>	127
L.6.2 Derajat Kointegrasi	128
L.7 Hasil Uji VECM	130
L.7.1 Kointegrasi Jangka Panjang	130

L.7.2 Kointegrasi Penyesuaian.....	131
L.7.2 Kointegrasi Jangka Pendek	131
L.8 Hasil Uji Kausalitas (<i>Granger Causality</i>)	133
L.9 Hasil Uji Asumsi Klasik.....	134
L.9.1 Hasil Uji Multikolinearitas.....	134
L.9.2 Hasil Uji Heteroskedastisitas	134
L.9.3 Hasil Uji Autokorelasi.....	135
L.9.4 Hasil Uji Normalitas	136
L.10 Hasil Uji Impulse Response Function (IRF)	136
L.10.1 Respon Inflasi Terhadap Guncangan Inflasi	137
L.10.2 Respon Inflasi Terhadap Guncangan <i>Budget Deficit</i>	138
L.10.3 Respon Inflasi Terhadap Guncangan <i>BI Rate</i>	138
L.10.4 Respon Inflasi Terhadap Guncangan <i>Exchange Rate</i>	139
L.10.5 Respon Inflasi Terhadap Guncangan Ekspektasi Inflasi	139
L.10.6 Respon Inflasi Terhadap Guncangan Jumlah Uang Beredar.....	140
L.10.7 Respon Inflasi Terhadap Guncangan OILP	140
L.10.9 Respon Inflasi Terhadap Guncangan WAGE	141
L.11 Hasil Uji Forecast Error Variance Decomposition (FEVD).....	142