

## BAB I

### PENDAHULUAN

#### 1.1 Latar Belakang

Runtun waktu atau *time series* adalah himpunan dari observasi yang diambil dalam periode waktu yang berurutan. Dalam berbagai sektor seperti ekonomi, *engineering*, sosial sains, dan berbagai sektor di dunia nyata banyak dilakukan observasi atau pencatatan data yang berbentuk runtun waktu. Data runtun waktu dapat diambil dalam rentang tahunan, bulanan, harian, dll. Dari data runtun waktu, dapat dilakukan analisis runtun waktu dimana menurut Box, Jenkins, dan Reinsel (2008) dapat digunakan untuk peramalan (*forecasting*) nilai dari runtun waktu yang akan datang berdasarkan data observasi masa lampau. Selain itu aplikasi runtun waktu juga dapat digunakan untuk pemeriksaan keterkaitan antara beberapa variabel deret waktu yang relevan dan penentuan model dinamis multivariat yang sesuai untuk merepresentasikan hubungan antar variabel dari waktu ke waktu.

Inflasi merupakan salah satu kondisi ekonomi yang tidak bisa terlepas dari perekonomian sebuah negara. Inflasi (*inflation*) adalah suatu gejala di mana tingkat harga umum mengalami kenaikan secara terus-menerus. Dalam pendekatan moneter, inflasi dinilai sebagai suatu fenomena moneter, yaitu keadaan yang disebabkan terlalu banyaknya uang yang beredar dibandingkan dengan kesediaan masyarakat untuk memiliki atau menyimpan uang tersebut (Muh.Nur, 2012). Inflasi yang berat merupakan masalah penting karena dapat menghancurkan perekonomian negara (Rangkuti, 2023). Contohnya, pada tahun 2007-2008 Zimbabwe mengalami inflasi harian sebesar 98 persen dikarenakan pencetakan uang dengan denominasi besar mencapai nilai 100 triliun dollar Zimbabwe untuk mendanai defisit anggaran negaranya. Tidak berhenti di situ, pada tahun 2008-2009 Zimbabwe juga mengalami inflasi sebesar harian 89,7 sextillion persen. Keadaan ini mengakibatkan harga-harga melampaui sangat tinggi sehingga walau pemerintah mencetak uang dengan denominasi

miliaran dan triliunan dolar Zimbabwe, uang-uang tersebut tidak ada nilainya. Dengan alasan yang serupa Venezuela pada tahun 2016-2022 mengalami inflasi yang tinggi mencapai 95365 % pada puncaknya di tahun 2019. Hal ini mengakibatkan masyarakat Venezuela kesusahan untuk memenuhi kebutuhan sehari-hari karena luhnya nilai mata uang mereka. Selain karena pencetakan uang berlebihan, terdapat juga beberapa negara yang mengalami inflasi dikarenakan terjadinya peperangan. Seperti inflasi pada tahun 1920 di Republik Weimar, Jerman pasca perang dunia pertama yang tercatat sebagai inflasi terburuk sepanjang sejarah. Selain itu di Yugoslavia, Angola, dan Nikaragua inflasi yang tinggi juga terjadi disebabkan oleh pecahnya perang saudara. Di Indonesia sendiri, inflasi tertinggi pernah terjadi pada tahun 1965 dengan inflasi sebesar 592% (Amaranggana, 2021). Adryamarthanino dan Indrawati (2022) berpendapat bahwa inflasi tersebut diakibatkan karena Anggaran Pendapatan dan Belanja Negara (APBN) defisit sebesar Rp 1.565,6 miliar. Karena besarnya inflasi, Pada tahun 1996 Presiden Soeharto melalui Kementerian Keuangan saat itu mengeluarkan Paket Kebijakan Stabilisasi dan Rehabilitasi Ekonomi (Paket Oktober 1966) untuk mengembalikan kestabilan ekonomi Indonesia. Kebijakan tersebut di antaranya berisi penurunan nilai uang dari Rp 500 dan Rp 1000 masing-masing menjadi Rp 50 dan Rp 100 atau disebut sanering I, pengurangan jumlah uang yang beredar, dan Sanering II yaitu pengurangan nilai uang Rp 1000 lama menjadi Rp 1. Implementasi kebijakan-kebijakan tersebut membuahkan hasil positif, di mana inflasi pada tahun 1969 dapat ditekan menjadi 9,9 persen.

Selain inflasi, pertumbuhan ekonomi merupakan salah satu indikasi penting bagi sebuah negara. Karena dapat dikatakan bahwa semakin naik pertumbuhan ekonomi, maka semakin naik pula standar hidup masyarakat. Pertumbuhan ekonomi merupakan perkembangan kegiatan dalam perekonomian yang menyebabkan barang dan jasa yang diproduksi masyarakat bertambah dan kemakmuran rakyat jadi meningkat (Nur dkk, 2023). Salah satu contoh mudah dari pertumbuhan ekonomi adalah adanya kawasan industri di Karawang yang menjadikan Karawang sebagai salah satu daerah dengan upah minimum regional (UMR) tertinggi.

Pertumbuhan ekonomi sendiri dapat dipengaruhi oleh beberapa faktor. Salah satunya adalah pertumbuhan penduduk. Pertumbuhan penduduk dapat berpengaruh positif ataupun negatif terhadap pertumbuhan ekonomi. Misalnya pada negara maju, pertumbuhan penduduk yang disertai sumber daya manusia (SDM) yang berkualitas akan membantu pertumbuhan ekonomi menuju ke arah yang lebih baik. Namun, misalnya pada negara berkembang yang masih memiliki tingkat pengangguran dan kemiskinan yang tinggi, pertumbuhan penduduk yang belum disertai dengan kualitas SDM yang mencukupi akan membuat pertumbuhan ekonomi merosot.

Faktor lain yang dapat mempengaruhi pertumbuhan ekonomi adalah sumber daya alam (SDA). Sumber daya alam yang melimpah dapat menjadi modal yang sangat berharga untuk menunjang pertumbuhan ekonomi. Namun SDA tidak dapat berdiri sendiri sebagai penunjang pertumbuhan ekonomi. Diperlukan SDM dan teknologi untuk dapat mengolah, membuat inovasi, serta ekspansi bisnis sehingga pertumbuhan ekonomi dapat meningkat.

Selain inflasi dan pertumbuhan, terdapat juga perdagangan internasional yang merupakan salah satu kegiatan perekonomian negara. Pada perdagangan internasional terdapat beberapa bidang, misalnya kegiatan ekspor dan impor. Kementerian Perdagangan mendefinisikan ekspor sebagai kegiatan mengeluarkan barang dan jasa dari wilayah suatu negara, baik bersifat komersial maupun bukan komersial (barang hibah, sumbangan, hadiah), serta barang yang akan diolah di luar negeri dan hasilnya dimasukkan kembali ke negara tersebut secara legal. Sedangkan impor didefinisikan sebagai kegiatan memasukan barang dan jasa yang dibeli oleh penduduk suatu negara dari penduduk negara lain yang berakibatnya arus keluar mata uang asing dari dalam negeri. Pada perdagangan internasional juga terdapat istilah Indeks Harga Perdagangan Internasional (IHPI). Badan Pusat Statistika (BPS) Boyolali dalam lamannya menyatakan bahwa Indeks Harga perdagangan Internasional (IHPI) mengukur perubahan keseluruhan komponen harga transaksi barang dan jasa antara penduduk suatu wilayah ekonomi dan penduduk seluruh dunia, yang artinya IHPI bukan merupakan harga actual melainkan perubahan harga dari periode sebelumnya. Pada

Indeks Harga Perdagangan Internasional (IHPI) BPS membaginya menjadi harga ekspor dan harga impor.

Penelitian mengenai faktor-faktor perekonomian negara tersebut telah banyak dilakukan sebelumnya. Lubis (2014) telah melakukan penelitian mengenai hubungan pertumbuhan ekonomi dan inflasi di Indonesia pada periode tahun 1986-2012 menggunakan metode *Error Correction Model* (ECM). Pada penelitiannya, Lubis (2014) menyatakan bahwa terdapat hubungan jangka panjang dan jangka pendek antara inflasi dan pertumbuhan ekonomi. Jumhur, dkk (2018) dalam penelitiannya menggunakan metode *multiple regression* menyatakan bahwa ekspor memiliki pengaruh positif yang signifikan terhadap inflasi di Indonesia dengan data pada periode tahun 1981-2016. Sedangkan impor juga memiliki pengaruh positif terhadap inflasi namun tidak secara signifikan (Jumhur dkk, 2018). Kemudian Dona, dkk (2022) pada penelitiannya mengenai beberapa faktor yang memengaruhi inflasi di Indonesia menggunakan metode *multiple regression* menyatakan bahwa ekspor memiliki pengaruh positif secara signifikan sedangkan impor memiliki pengaruh negative secara signifikan terhadap inflasi. Penelitian tersebut menggunakan data bulanan pada periode tahun 2014 – 2018.

Pada makalah ini akan dilihat pengaruh pertumbuhan ekonomi, ekspor, dan impor terhadap inflasi. Karena faktor-faktor yang dibahas merupakan faktor ekonomi, maka pada makalah ini akan digunakan model *Threshold Vector Autoregressive* (TVAR). TVAR merupakan generalisasi dari model *Vector Autoregressive* (VAR) yang biasa digunakan untuk melihat hubungan dari data runtun waktu. TVAR biasa digunakan untuk memodelkan data runtun waktu dalam bidang finansial.

## 1.2 Rumusan Masalah

Berdasarkan latar belakang yang telah dituturkan sebelumnya, berikut adalah rumusan masalah yang akan diangkat dalam makalah ini :

1. Bagaimana model persamaan *Threshold Vector Autoregressive* yang terbentuk dengan menggunakan data inflasi, data pertumbuhan ekonomi, data ekspor, dan data impor di Indonesia?
2. Seberapa besar hubungan antara inflasi terhadap pertumbuhan ekonomi, ekspor, dan impor di Indonesia?

### **1.3 Tujuan Penelitian**

Berdasarkan rumusan-rumusan masalah yang dipaparkan, tujuan penelitian ini adalah sebagai berikut :

1. Mengetahui model persamaan *Threshold Vector Autoregressive* yang terbentuk dengan menggunakan data inflasi, data pertumbuhan ekonomi, data ekspor, dan data impor di Indonesia
2. Mengetahui seberapa besar hubungan antara inflasi terhadap pertumbuhan ekonomi, ekspor, dan impor di Indonesia

### **1.4 Manfaat Penelitian**

Dari penelitian yang dilakukan dalam makalah ini, diharapkan dapat memberikan beberapa manfaat seperti berikut :

1. Secara teoritis, diharapkan makalah ini dapat memberikan manfaat pada pembaca berupa wawasan statistika mengenai *Threshold Vector Autoregressive*. Selain itu juga, pembaca juga dapat mengetahui tentang hubungan antara pertumbuhan ekonomi dan inflasi di Indonesia
2. Secara praktis, makalah ini dapat memberikan manfaat berupa referensi, bahan pertimbangan, atau informasi tambahan bagi pihak yang ingin melakukan penelitian mengenai pertumbuhan ekonomi dan inflasi di Indonesia juga hubungan di antaranya. Diharapkan juga makalah ini dapat memberikan manfaat bagi pihak yang ingin melakukan penelitian menggunakan model *Threshold Vector Autoregressive*

