

BAB III

METODE PENELITIAN

A. Jenis Penelitian

Jenis penelitian yang dilakukan merupakan penelitian kuantitatif. Fokus penelitian kuantitatif adalah menganalisis data numerik atau angka, yang selanjutnya diperiksa menggunakan teknik statistik yang tepat. *Vector Error Correction Model* (VECM) adalah metode yang digunakan pada penelitian ini.

B. Sumber Data

Data yang dipakai menggunakan data sekunder. Data BI Rate, inflasi dan kurs diperoleh dari *website* resmi Bank Indonesia dan data PDB diperoleh dari *website* resmi Badan Pusat Statistik Indonesia. Data tersebut merupakan data triwulan BI Rate, inflasi, kurs dan PDB sejak Januari 2010 hingga Desember 2023 sebanyak 56 data.

C. Variabel Penelitian

Variabel penelitian adalah segala sesuatu yang berbentuk apa saja yang ditetapkan untuk dipelajari sehingga diperoleh informasi tentang hal tersebut, kemudian ditarik kesimpulannya. Adapun variabel-variabel pada penelitian ini yaitu, BI Rate (X_1), inflasi (X_2), kurs (X_3) dan PDB (X_4).

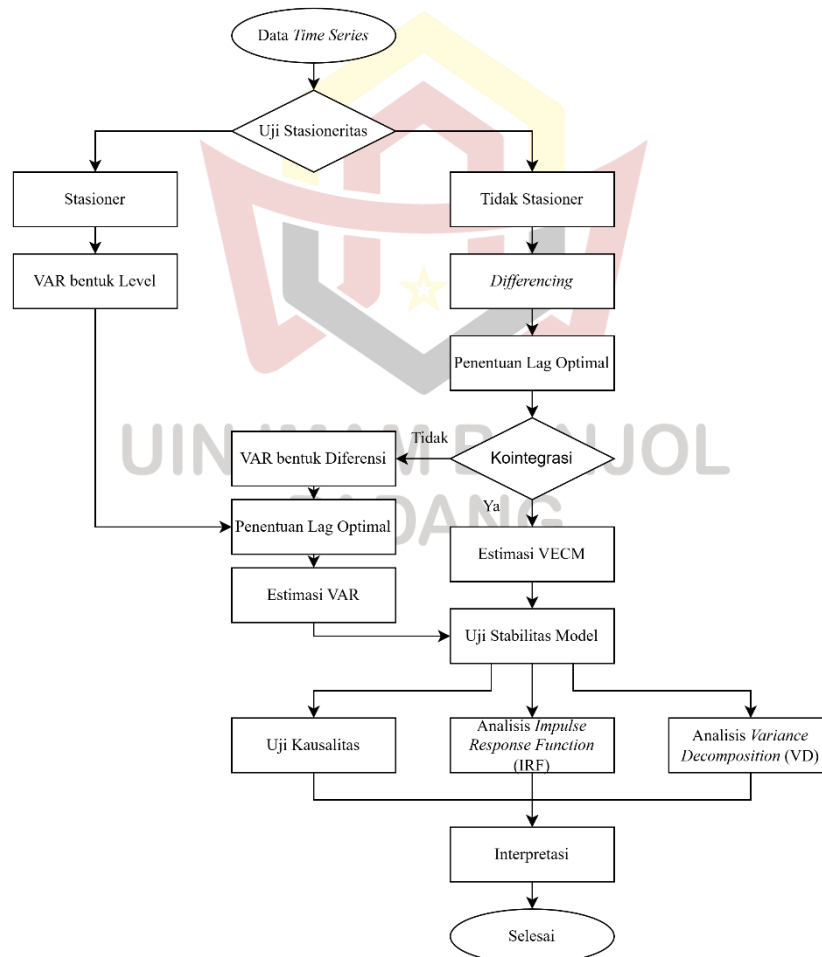
D. Tahapan Analisis Data

Analisis data dilakukan dengan bantuan *software* Eviews 10. Adapun tahapan analisis yang dilakukan pada penelitian ini yaitu:

1. Melakukan uji stasioneritas dengan cara menerapkan uji akar unit (*Unit Root test*), dimulai dari tingkat level, *first difference* dan seterusnya.
2. Menentukan *lag* optimal menggunakan beberapa kriteria, yaitu *Akaike Information Criterion* (AIC), *Schwarz Information Criterion* (SC), *Final Prediction Error* (FPE) dan *Hannan-Quinn Information Criterion* (HQ).
3. Melakukan uji kointegrasi dengan menerapkan uji kointegrasi *Johansen*. Jika terdapat kointegrasi, maka data dapat diolah menggunakan metode analisis VECM.
4. Estimasi VECM.

5. Melakukan pengecekan stabilitas VECM menggunakan *AR Roots Table*.
6. Melakukan uji kausalitas dengan menerapkan uji kausalitas Granger (*Granger Causality Test*) untuk melihat hubungan kausalitas antarvariabel.
7. Memeriksa hasil dari *Impulse Response Function* (IRF) untuk melihat respon antar variabel.
8. Memeriksa hasil dari *Variance Decomposition* (VD) untuk melihat besarnya kontribusi pengaruh masing-masing variabel.
9. Menarik kesimpulan.

Tahapan analisis data tersebut dapat digambarkan melalui diagram alir sebagai berikut:



Gambar 3.1 Diagram Alir Tahapan Analisis Data