

BAB I

PENDAHULUAN

A. Latar Belakang

Kajian dalam konteks ekonomi yang menjelaskan gambaran umum mengenai kegiatan perekonomian dikenal sebagai teori makroekonomi (Valentika dkk., 2021). Salah satu tujuan utamanya adalah menjaga stabilitas perekonomian agar proses pembangunan dapat berjalan secara berkelanjutan. Stabilitas ekonomi ini dapat dilihat melalui beberapa indikator makroekonomi, salah satunya adalah inflasi (Fadilla & Aravik, 2018). Inflasi adalah suatu kondisi ketika harga barang dan jasa secara umum mengalami kenaikan secara berkelanjutan, sehingga dapat mempengaruhi daya beli masyarakat serta aktivitas perekonomian secara keseluruhan (Yudawisastra dkk., 2024).

Pada tingkat tertentu, inflasi masih bisa ditoleransi dan bahkan dapat mendorong aktivitas ekonomi. Inflasi yang ringan dapat memberikan manfaat bagi perekonomian, seperti meningkatnya partisipasi masyarakat dalam aktivitas produktif seperti bekerja, menabung, dan melakukan investasi (Suparmono, 2018). Namun, inflasi yang tinggi dan tidak stabil dapat menimbulkan berbagai masalah ekonomi, seperti menurunnya daya beli masyarakat, meningkatnya ketidakpastian ekonomi, serta terganggunya aktivitas produksi dan distribusi barang dan jasa. Kondisi tersebut pada akhirnya dapat memengaruhi kinerja perekonomian secara luas (Larasati & Sulasmiyati, 2018). Dengan demikian, inflasi memiliki peran penting sehingga harus diperhatikan dalam analisis ekonomi makro.

Selain memengaruhi kondisi perekonomian secara umum, inflasi juga memiliki keterkaitan dengan aktivitas perdagangan internasional, khususnya ekspor dan impor. Peningkatan inflasi menyebabkan penurunan daya saing produk domestik di pasar internasional, karena harga barang lokal menjadi lebih tinggi dibandingkan barang dari luar negeri. Hal ini dapat menyebabkan penurunan ekspor. Di sisi lain, impor cenderung meningkat karena barang asing menjadi lebih murah secara relatif (Valentika dkk., 2020). Perubahan pada ekspor dan

impor tersebut selanjutnya dapat berdampak pada neraca perdagangan dan stabilitas ekonomi suatu wilayah.

Salah satu provinsi yang berada di Indonesia adalah Sumatera Barat yang memiliki aktivitas perdagangan internasional cukup signifikan melalui kegiatan ekspor dan impor. Berdasarkan data yang dipublikasikan oleh Badan Pusat Statistik (BPS) Provinsi Sumatera Barat, nilai ekspor di bulan Januari 2013 tercatat senilai US\$196,50 juta mengalami fluktuasi dan kemudian naik menjadi US\$219,03 juta pada Januari 2022. Untuk nilai impor, pada periode yang sama juga terjadi perubahan yang cukup besar, yaitu dari US\$88,30 juta pada Januari 2013 turun menjadi US\$43,51 juta pada Januari 2022. Perkembangan inflasi di Sumatera Barat juga menunjukkan fluktuasi, dengan tingkat inflasi tertinggi terjadi pada tahun 2014 yang mencapai 11,58%. Fluktuasi ini menunjukkan adanya dinamika dalam perekonomian daerah yang dipengaruhi oleh berbagai faktor makroekonomi, baik dari dalam maupun luar negeri. Kondisi inilah yang membuat perlunya analisis yang lebih mendalam mengenai pola hubungan antara inflasi, ekspor, dan impor di Provinsi Sumatera Barat.

Data inflasi, ekspor dan impor dalam penelitian ini merupakan data deret waktu (*time series*), yaitu data yang diperoleh melalui pengamatan secara berurutan dari waktu ke waktu (Aulia dkk., 2019). Metode yang dapat diterapkan dalam analisis deret waktu (*time series*) diantaranya yaitu, *Vector Autoregression* (VAR) yang digunakan ketika data telah memenuhi asumsi stasioneritas. Sementara itu, apabila data tidak stasioner namun memiliki hubungan kointegrasi antarvariabel, sehingga metode yang digunakan adalah *Vector Error Correction Model* (VECM). Model VAR dikemukakan oleh Sims pada tahun 1980 sebagai alternatif terhadap model persamaan simultan. Pendekatan ini mengasumsikan bahwa seluruh variabel dalam sistem diperlakukan sebagai endogen. Pendekatan ini digunakan untuk menganalisis hubungan timbal balik antarvariabel deret waktu (Belsley & Kontoghiorghes, 2009). Selanjutnya, Engle dan Granger mengembangkan VAR menjadi VECM untuk menangani kasus dimana terdapat hubungan kointegrasi dan hubungan jangka panjang antara variabel-variabel yang diamati (Sulistiana, 2017).

Beberapa penelitian terdahulu telah mengkaji hubungan berbagai variabel makroekonomi dengan pendekatan *Vector Error Correction Model* (VECM), seperti penelitian yang dilakukan oleh Larasati dan Sulasmiyati (2018) mengkaji keterkaitan tingkat inflasi, ekspor, dan tenaga kerja. Saskara dan Batubara (2015) menganalisis ekspor, impor, dan produk domestik bruto (PDB), serta Valentika dkk. (2020) yang fokus pada peramalan kurs, inflasi, impor, dan ekspor. Namun, penelitian-penelitian tersebut menganalisis hubungan variabel makroekonomi pada tingkat nasional. Dengan demikian, terdapat kesenjangan penelitian yang secara spesifik dan simultan memodelkan hubungan dinamis jangka panjang dan jangka pendek antara inflasi, ekspor, dan impor dalam konteks perekonomian regional, khususnya Provinsi Sumatera Barat. Karakteristik struktural, pola perdagangan, dan tekanan inflasi di tingkat provinsi sangat mungkin berbeda dengan agregat nasional, sehingga temuan pada level nasional belum tentu dapat digeneralisasi.

Dalam penelitian ini, metode VECM dipilih karena mampu menganalisis hubungan dalam periode jangka panjang dan periode jangka pendek antarvariabel yang tidak stasioner namun saling berkointegrasi. Metode ini tidak membedakan antara variabel independen dan variabel dependen, serta menghasilkan estimasi yang lebih efisien dibandingkan dengan sistem persamaan yang kompleks (Ekananda, 2018). Berdasarkan pertimbangan tersebut, tujuan dari penelitian ini untuk menganalisis hubungan antara inflasi, ekspor dan impor di Provinsi Sumatera Barat selama periode 2013 hingga 2022 dengan metode VECM. Oleh karena itu, penelitian yang dilakukan ini diberi judul **“Metode Vector Error Correction Model (VECM) dalam Menganalisis Hubungan antara Inflasi, Ekspor dan Impor Sumatera Barat”**.

B. Rumusan Masalah

Berdasarkan latar belakang yang sudah penulis jelaskan di atas, maka rumusan masalah menjadi fokus penelitian ini adalah:

1. Bagaimana hubungan kausalitas antara variabel inflasi, ekspor, dan impor di Provinsi Sumatera Barat?

2. Bagaimana respons variabel inflasi, ekspor, dan impor terhadap perubahan yang terjadi pada masing-masing variabel?
3. Bagaimana besarnya kontribusi variabel inflasi, ekspor dan impor terhadap variabilitas masing-masing variabel?

C. Batasan Masalah

Untuk memastikan agar penulisan dan pembahasan tetap sesuai dengan pokok bahasan, batasan masalah dalam penelitian ini adalah sebagai berikut:

1. Variabel yang dianalisis dalam penelitian ini adalah inflasi, ekspor dan impor.
2. Data inflasi, ekspor dan impor diperoleh dari *website* resmi Badan Pusat Statistik Sumatera Barat.
3. Data yang digunakan merupakan data bulanan dari tahun 2013 hingga 2022 sebanyak 120 data.
4. Metode yang digunakan yaitu *Vector Error Correction Model* (VECM).

D. Tujuan Penelitian

Berdasarkan rumusan masalah yang telah penulis paparkan, maka tujuan yang akan dicapai dalam penelitian ini yaitu:

1. Mengetahui hubungan kausalitas antara inflasi, ekspor, dan impor di Provinsi Sumatera Barat.
2. Mengetahui respons variabel inflasi, ekspor, dan impor terhadap perubahan yang terjadi pada masing-masing variabel.
3. Mengetahui besarnya kontribusi variabel inflasi, ekspor, dan impor terhadap variabilitas masing-masing variabel.

E. Manfaat Penelitian

Berdasarkan tujuan penelitian yang telah penulis paparkan, hasil dari penelitian ini diharapkan mampu memberikan manfaat bagi berbagai pihak, di antaranya:

1. Bagi penulis

Penelitian ini merupakan kesempatan bagi penulis untuk mendalami hubungan kausalitas antar variabel makroekonomi, yaitu inflasi, ekspor, dan impor, dengan menggunakan metode *Vector Error Correction Model* (VECM).

Melalui penelitian ini penulis dapat menerapkan teori yang telah dipelajari selama perkuliahan ke dalam permasalahan nyata, sehingga mampu menambah wawasan, meningkatkan kemampuan analisis, serta mengasah ketajaman berpikir ilmiah.

2. Bagi pihak lain

Penelitian ini diharapkan dapat memberikan informasi mengenai dinamika hubungan antara inflasi, ekspor dan impor di Provinsi Sumatera Barat periode 2013 hingga 2022. Hasil penelitian ini dapat menjadi bahan pertimbangan bagi pihak terkait, khususnya pemerintah daerah dalam menyusun kebijakan ekonomi di Sumatera Barat. Selain itu, penelitian ini diharapkan dapat menjadi referensi serta bahan kajian tambahan bagi peneliti selanjutnya yang tertarik untuk meneliti topik serupa.

