

## ABSTRAK

Ni'mah, Eva Naviatun, 2020, Analisis *Vector Error Correction Model* (VECM) dalam Peramalan Laju Inflasi Terhadap BI Rate, Kurs dan Jumlah Uang Beredar (JUB) , Skripsi, Program Studi Statistika, Universitas Muhammadiyah Semarang, Pembimbing: I. Indah Manfaati Nur, S.Si., M.Si, II. Prizka Rismawati Arum, M.Stat

*Vector Error Correction Model* (VECM) adalah salah satu model multivariate runtun waktu (*time series*). VECM disebut juga dengan VAR yang terestriksi dengan data stasioner pada *differencing* pertama dan memiliki kointegrasi. Data yang digunakan dalam penelitian ini adalah Inflasi, Bi Rate, Kurs dan Jumlah Uang Beredar dari periode Januari 2008 sampai Desember 2019. Tujuan penelitian ini adalah menganalisis hubungan Inflasi terhadap Bi Rate, Kurs dan Jumlah Uang Beredar kemudian meramalkan semua variabel menggunakan metode *Vector Error Correction Model* (VECM). Berdasarkan hasil penelitian diperoleh data stasioner pada *first difference* dan terdapat kointegrasi antara Inflasi, Bi Rate, Kurs dan Jumlah Uang Beredar. Hasil analisis hubungan antar variabel yang di uji menggunakan kausalitas Granger menghasilkan hubungan antara variabel inflasi dengan kurs, Bi Rate dengan jumlah uang beredar dan Bi Rate dengan kurs. Hasil peramalan Inflasi, Bi Rate dan Kurs menggunakan metode VECM mengalami penurunan dari periode sebelumnya kecuali hasil peramalan Jumlah Uang Beredar yang mengalami peningkatan dari periode sebelumnya. Berdasarkan keakuratan hasil peramalan diperoleh data ramalan yang mendekati data aktual yang dapat dilihat dari keakuratan nilai RMSE. Nilai RMSE Inflasi sebesar 0,015239, Bi Rate sebesar 0,009597, Kurs sebesar 1306,205 dan Jumlah Uang beredar sebesar 25465,34.

**Kata Kunci:** Inflasi, Bi Rate, Kurs, Jumlah Uang Beredar, *Vector Error Correction Model* (VECM).