

Abstraksi**SKRIPSI SARJANA EKONOMI**

NAMA : TRI HARTANTO

N.I.M. : 040510550

TAHUN PENYUSUNAN : 2011

JUDUL :**ANALISIS KETERKAITAN HARGA ANTAR KELOMPOK KOMODITAS
PEMBENTUK INFLASI DI INDONESIA PERIODE 2004 – 2010****ISI :**

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis hubungan dan interaksi antar kelompok komoditas yang menjadi penentu tingkat inflasi di Indonesia. Data yang digunakan ialah data bulanan dari Januari 2004 hingga Desember 2010, estimasi menggunakan *Vector Autoregression (VAR)* untuk menganalisis pergerakan harga komoditas di dalam model. Hasil estimasi VAR dapat dilihat dari uji *Impulse Response* dan *Variance Decomposition*. Hasil *Impulse Response* menunjukkan bahwa meskipun tidak semua kelompok komoditas memiliki hubungan tetapi ada beberapa kelompok komoditas yang berkontribusi dalam menentukan harga kelompok komoditas lain. Ketidakstabilan harga kelompok komoditas makanan jadi, minuman, rokok, dan tembakau dipengaruhi oleh kelompok bahan makanan. Hasil *Variance Decomposition* secara umum, semua kelompok komoditas dipengaruhi oleh pergerakan kelompoknya sendiri, terutama untuk kelompok barang yang harganya diatur pemerintah (*administered prices*), seperti kelompok perumahan, air, listrik, gas, dan bahan bakar. Selain itu, kelompok bahan makanan yang pergerakan harganya dipengaruhi oleh faktor alam seperti cuaca atau musim panen.

Kata kunci: inflasi; *vector autoregression*; *impulse response*; *variance decomposition*; *administered prices*

SUBJEK/OBJEK PENELITIAN :

INFLASI DAN TINGKAT HARGA

DAERAH PENELITIAN :

INDONESIA

ABSTRACT

BACHELOR THESIS

NAME : TRI HARTANTO

N.I.M. : 040510550

ARRANGED YEAR : 2011

THEME :

ANALITICS INTERACTION OF AMONG COMMODITY GROUPS PRICE WHICH DETERMINED THE INFLATION RATE IN INDONESIA PERIOD 2004 – 2010

CONTAIN :

This study analyzes the correlation and the interaction among commodity groups which determined the inflation rate in Indonesia. Using the monthly data from January 2004 to December 2010, the estimation applies the vector autoregression (VAR) in order to analyze the dynamics of commodity prices in the model. Estimation of VAR can be explained with Impulse Response and Variance Decomposition. The results of Impulse Response show although not all commodity groups have relation but same commodity having contribution in determining other group prices. We found that the volatility of prepared food, drink, cigarette, and tobacco is affected by food group. The results of Variance Decomposition show that All commodity groups are mostly affected by the government policy (administered prices), like the housing group, water, electricity, gas, and the fuel. And also the food group which the prices movement was influenced by natural factor take the weather or the harvest.

Keywords: inflation; vector autoregression; impulse response; variance decomposition; administered prices

RESEARCH SUBJECT/OBJECT :

INFLATION AND PRICE LEVEL

AREA RESEARCH :

INDONESIA