

**ANALISIS KAUSALITAS GRANGER ANTARA
INFLASI DENGAN PENGANGGURAN DI INDONESIA
PERIODE TAHUN 1987-2013**



NASKAH PUBLIKASI

Diajukan Untuk Memenuhi

Tugas dan Syarat-Syarat Guna Memperoleh Gelar Sarjana Ekonomi
Program Studi Ekonomi Pembangunan Fakultas Ekonomi dan Bisnis
Universitas Muhammadiyah Surakarta

Disusun oleh:

LILIS NURUL QOTIMAH

B300 100 050

**PROGRAM STUDI EKONOMI PEMBANGUNAN
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS
UNIVERSITAS MUHAMMADIYAH SURAKARTA**

2014

ABSTRAK

Penelitian ini berjudul “Analisis Kausalitas Granger Antara Inflasi dengan Pengangguran di Indonesia Periode Tahun 1987-2013”. Tujuan penelitian ini adalah untuk menganalisa antara inflasi dengan pengangguran di Indonesia dan untuk menganalisis pola hubungan antara inflasi dengan pengangguran di Indonesia tahun 1987-2013

Penelitian ini dilakukan dengan menggunakan uji kausalitas granger yaitu merupakan sebuah metode analisis guna mengetahui hubungan kausalitas antara dua variabel. Disamping itu untuk mendapatkan hasil estimasi yang dilakukan uji stasioneritas, yang selanjutnya di lakukan uji kausalitas granger tersebut. Variabel dalam penelitian ini adalah variabel Inflasi dengan variabel Pengangguran. Hasil estimasi dari variabel Inflasi dengan Pengangguran yang ditunjukkan dengan uji stasioneritas bahwa kedua variabel tersebut telah stasioner dapat ditunjukkan dengan metode ADF koefisien δ -1,077736 dan sebesar -0,850556. Dan pada uji kausalitas granger menunjukkan ada hubungan kausalitas searah ditunjukkan pada lag 3 dengan nilai probabilitas sebesar 0,0009 lebih kecil dari $\alpha = 0,05$.

Dari hasil analisis dapat disimpulkan bahwa terdapat kausalitas searah antara Inflasi dengan Pengangguran yaitu Inflasi tidak mempengaruhi Pengangguran akan tetapi Pengangguran mempengaruhi Inflasi.

Kata Kunci : *Inflasi, Pengangguran, Uji kausalitas Granger.*

HALAMAN PENGESAHAN

Yang bertanda tangan di bawah ini telah membaca naskah publikasi dengan judul : **Analisis Kausalitas Granger Antara Inflasi Dengan Pengangguran di Indonesia Periode Tahun 1987-2013**

Yang ditulis oleh :

LILIS NURUL OOTIMAH
B 300 100 050

Penandatanganan berpendapat bahwa naskah publikasi tersebut telah memenuhi syarat untuk diterima.

Surakarta, 18 Desember 2014
Pembimbing




(Dr. Daryono Soebagiyo, M.Ec)

Mengetahui,

Dekan Fakultas Ekonomi Dan Bisnis

Universitas Muhammadiyah Surakarta




(Dr. Triyono, M.Si)
NIP : 642

A. PENDAHULUAN

1. Latar Belakang

Salah satu titik awal kelahiran ilmu ekonomi makro adalah adanya permasalahan ekonomi jangka pendek yang tidak dapat diatasi oleh teori ekonomi klasik. Masalah jangka pendek ekonomi tersebut yaitu inflasi dan pengangguran. Munculnya ekonomi makro dimulai dengan terjadinya *depresi* ekonomi Amerika Serikat pada tahun 1929. *Depresi* merupakan suatu malapetaka yang terjadi dalam ekonomi di mana kegiatan produksi terhenti akibat adanya inflasi yang tinggi dan pada saat yang sama terjadi pengangguran yang tinggi pula. (Amir, 2010).

Pengangguran merupakan masalah yang ada di seluruh negara di dunia, terutama di negara-negara sedang berkembang. Sebenarnya, pengangguran merupakan masalah sosial, namun pada akhirnya menjadi masalah ekonomi juga, karena akan mempengaruhi tingkat pertumbuhan perekonomian negara. Inflasi merupakan salah satu indikator penting dalam perekonomian yang tidak bisa diabaikan, karena dapat menimbulkan dampak yang sangat luas baik terhadap perekonomian maupun kesejahteraan masyarakat. Bagi perekonomian, inflasi yang tinggi dan menyebabkan timbulnya ketidakstabilan, menurunkan gairah menabung dan berinvestasi, menghambat usaha peningkatan ekspor, menyebabkan melambatnya pertumbuhan ekonomi, maupun bisa berdampak pada meningkatnya jumlah pengangguran. (Rizki, 2012)

Pengangguran dan inflasi adalah dua masalah ekonomi utama yang dihadapi setiap masyarakat. Kedua masalah ekonomi itu dapat mewujudkan beberapa efek buruk yang bersifat ekonomi, politik, dan sosial (Sukirno, 2008). Inflasi merupakan kecenderungan dari harga-harga untuk menaik secara umum dan terus-menerus. Semua negara di dunia selalu menghadapi permasalahan inflasi ini. Oleh karena itu, tingkat inflasi yang terjadi dalam suatu negara merupakan salah satu ukuran untuk mengukur baik buruknya masalah ekonomi yang dihadapi suatu negara. Sedangkan pengangguran adalah jumlah angkatan kerja

yang belum mendapatkan pekerjaan (BPS, 2012). Keadaan ini berarti penciptaan kesempatan kerja dan kestabilan harga tidak dapat terjadi bersama-sama. Jika pemerintah menghendaki kestabilan harga, maka harus mau menanggung beban tingkat pengangguran yang tinggi. Demikian pula sebaliknya, jika pemerintah mau menciptakan kesempatan kerja yang lebih luas, maka konsekuensinya angka inflasi akan cenderung lebih tinggi. Kedua pilihan tersebut tentu saja sama-sama sulit untuk dilakukan. Padahal tingkat inflasi yang rendah bersama-sama dengan tingkat pengangguran yang juga rendah, merupakan tujuan yang ingin dicapai oleh semua negara dan menjadi prioritas dalam pembangunan ekonomi. (Ahmad, 2007)

2. Tujuan Penelitian

Penelitian ini bertujuan untuk :

- a. Menganalisis keterkaitan antara inflasi dengan pengangguran di Indonesia tahun 1987-2013.
- b. Menganalisis pola hubungan antara inflasi dengan pengangguran di Indonesia tahun 1987-2013.

B. LANDASAN TEORI

1. Teori Inflasi

a. Pengertian Inflasi

Inflasi adalah proses kenaikan harga-harga umum barang secara terus menerus. Ini tidak berarti bahwa harga-harga berbagai macam barang itu naik dengan persentase yang sama. Mungkin dapat terjadi kenaikan tersebut tidaklah bersamaan. Yang penting dapat kenaikan harga umum barang secara terus-menerus selama suatu periode tertentu. Kenaikan yang terjadi hanya sekali saja (meskipun dengan persentase yang cukup besar) bukanlah merupakan inflasi. (Nopirin,2000)

b. Penyebab munculnya Inflasi

Sumber utama terjadinya inflasi adalah karena kelebihan permintaan sehingga uang yang beredar di masyarakat bertambah

banyak. Sehingga menurut teori kuantitas, penyebab terjadinya inflasi dibedakan menjadi dua:

- a. Inflasi yang timbul karena permintaan masyarakat akan berbagai barang terlalu kuat. Inflasi semacam ini disebut *demand pull inflation*.
- b. Inflasi yang timbul karena kenaikan biaya produksi. Ini disebut *Cost Push Inflation*. Tingkat penawaran lebih rendah jika dibandingkan dengan tingkat permintaan. Ini karena adanya kenaikan harga faktor produksi sehingga produsen terpaksa mengurangi produksinya. Apabila keadaan tersebut berlangsung cukup lama, maka terjadilah inflasi yang disertai dengan resesi.

2. Teori Pengangguran

a. Pengertian Pengangguran

Pengangguran adalah suatu keadaan dimana seseorang yang tergolong dalam angkatan kerja ingin mendapatkan pekerjaan tetapi belum memperolehnya. Ditinjau dari sudut individual, pengangguran menimbulkan masalah ekonomi dan sosial kepada siapa yang mengalaminya. Ketiadaan pendapatan menyebabkan para penganggur harus mengurangi pengeluaran konsumsinya. Selain itu pengangguran juga dapat mengganggu taraf kesehatan keluarga. (Sukirno, 2004)

b. Cara Mengatasi Pengangguran

Di era sekarang ini, masalah pengangguran merupakan salah satu hal yang menjadi perhatian di tiap negara. Tidak hanya di Indonesia, di negara-negara Eropa, bahkan di negeri super adidaya yaitu Amerika Serikat juga mengalami kendala dalam menghadapi masalah pengangguran. Hal itu terjadi sebagai dampak dari peningkatan penduduk yang begitu cepat tanpa di dukung dengan penciptaan lapangan kerja yang seimbang.

Kenyataan menunjukkan bahwa masalah pengangguran merupakan masalah yang berdampak buruk pada aktivitas

perekonomian masyarakat, baik pada kegiatan produksi, distribusi, maupun konsumsi.

Berikut beberapa hal yang dapat dilakukan sebagai cara mengatasi pengangguran di Indonesia. Diantaranya adalah sebagai berikut : (Ismayanto, 2013)

- 1) Memperluas kesempatan kerja, dengan membuka lapangan kerja baru, baik dibidang pertanian, industri, perdagangan, maupun jasa.
- 2) Meningkatkan kualitas pendidikan, sehingga para lulusan sudah siap pakai untuk menjadi tenaga yang terampil.
- 3) Meningkatkan kualitas tenaga kerja, dengan memberikan pendidikan ketrampilan melalui pendidikan formal dan nonformal.
- 4) Memberikan kesempatan kerja ke luar negeri, melalui penyaluran Tenaga Kerja Indonesia (TKI).
- 5) Mendorong tumbuh kembangnya usaha-usaha atau industry rumah tangga.
- 6) Memberikan peranan KB untuk menekan laju pertumbuhan penduduk.

3. Hubungan Inflasi dengan Pengangguran

Kurva philips merupakan suatu teori yang mengemukakan hubungan antara inflasi dan pengangguran. Kurva Phillips pertama kali dikemukakan oleh A.W. Phillips, pada tahun 1958. Phillips menyimpulkan bahwa terdapat hubungan negatif antara pengangguran dan perubahan tingkat upah. Phillips menggunakan perubahan tingkat upah karena upah akan mempengaruhi harga barang dan jasa dan pada akhirnya juga mempengaruhi inflasi. Ada 2 faktor yang mempengaruhi laju perubahan tingkat upah yaitu laju perubahan permintaan tenaga kerja, dan pengangguran. (Phillips, 1958)

C. METODE PENELITIAN

Jenis data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data sekunder yang berupa data bulanan time series periode tahun 1987-2013. Metode pengumpulan data ini berupa dokumentasi, yaitu metode pengumpulan data yang diperoleh dari berbagai media cetak maupun elektronik serta dari instansi terkait yaitu Badan Pusat Statistik (BPS). Alat analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah Uji Kausalitas Granger. Data yang digunakan adalah variabel inflasi dan pengangguran. Uji kausalitas adalah pengujian untuk menentukan sebab akibat antara peubah dalam sistem VAR. Konsep dari kausalitas granger X dikatakan menyebabkan Y jika realisasi X terjadi lebih dahulu daripada Y dan realisasi Y tidak terjadi mendahului realisasi X (Ariefianto, 2012). Model kausalitas Granger dapat diformulasikan sebagai berikut (Junaidi, 2012).

$$INF_t = \sum_{i=l}^m \alpha_i INF_{t-i} + \sum_{j=l}^m \beta_j PNG_{t-j} + U_{1t}$$
$$PNG_t = \sum_{i=l}^m \lambda_i PNG_{t-i} + \sum_{j=l}^m \delta_j INF_{t-j} + U_{2t}$$

Dimana :

INF =Inflasi

Png =Pengangguran (Unemployment)

Ut =Variabel Pengganggu

m =Jumlah lag

D. HASIL PENELITIAN

Berdasarkan hasil perhitungan Uji Kausalitas Granger antara inflasi dengan pengangguran di Indonesia dapat dilihat pada tabel berikut ini.

	<i>Null Hypothesis</i>	F-statistik	<i>Probability</i>
K=3	INF does not Granger Cause DUNEMP1	1,86626	0,1760
	DUNEMP does not Granger Cause INF	9,12242	0,0009

Sumber: Hasil Olah Data

Dari hasil diatas hipotesis nol untuk INF (Inflasi) mempengaruhi DUNEMP (Laju Pengangguran), dapat dilihat bahwa probabilitas $(0,1760) > \alpha (0,05)$ pada lag 3. Hal ini berarti bahwa H_0 diterima, yang berarti bahwa INF tidak menyebabkan DUNEMP. Atau dengan kata lain, dapat disimpulkan bahwa Inflasi tidak menyebabkan Pengangguran.

Untuk hasil kedua, dimana hipotesis nol untuk DUNEMP (Laju Pengangguran) mempengaruhi INF (Inflasi), dapat dilihat bahwa probabilitas $(0,0009) < \alpha (0,05)$ pada lag 3. Hal ini berarti bahwa H_0 ditolak, yang berarti bahwa DUNEMP menyebabkan INF. Atau dengan kata lain, dapat disimpulkan bahwa Pengangguran menyebabkan terjadinya Inflasi.

Berdasarkan hasil penelitian tersebut dapat disimpulkan bahwa ada pola hubungan kausalitas satu arah antar variabel Inflasi dan Pengangguran di Indonesia. Yang artinya bahwa tingkat kenaikan pengangguran setiap tahunnya mempengaruhi tingkat inflasi setiap tahunnya. Dan sebaliknya, tingkat kenaikan inflasi setiap tahunnya tidak mempengaruhi tingkat kenaikan pengangguran setiap tahunnya.

E. SIMPULAN DAN SARAN

1. Simpulan

Analisis kausalitas granger antara Inflasi dengan Pengangguran di Indonesia memperlihatkan hasil analisis pengolahan data, dapat disimpulkan bahwa terdapat hubungan kausalitas satu arah yaitu variabel Pengangguran mempengaruhi Inflasi. Hal ini dapat disimpulkan dengan terlebih dahulu melakukan beberapa pengujian diantaranya sebagai berikut :

1. Uji Stasioneritas

Hasil uji stasioneritas menunjukkan bahwa variabel Inflasi stasioner di tingkat level, sedangkan variabel Pengangguran ditingkat level tidak stasioner. Jika dilihat dari variabel Inflasi, kestasioneran tersebut ditunjukkan dari ketiga model terbaik yang digunakan, dengan kriteria *AIC minimum* semua model memiliki nilai t-statistik lebih besar dari nilai *Mackinnon Critical Value* sebesar 5%, sehingga variabel Inflasi stasioner. Berbeda dengan variabel pengangguran yang tidak stasioner pada tingkat level, yang ditunjukkan dari ketiga model terbaik dengan kriteria *AIC minimum*, menunjukkan bahwa semua model memiliki nilai t-statistik lebih kecil dari nilai *Mackinnon Critical Value* sebesar 5%, sehingga variabel Pengangguran tidak stasioner. Untuk itu perlu melakukan uji stasioneritas pada log variabel tersebut. Sehingga variabel menjadi LOGUNEMP. Dari ketiga model terbaik dengan kriteria *AIC minimum*, menunjukkan bahwa semua model memiliki nilai t-statistik lebih kecil dari nilai *Mackinnon Critical Value* sebesar 5%, sehingga variabel Log Pengangguran tidak stasioner.

2. Uji Derajat Integrasi

Hasil pengujian derajat pertama (*1st Difference*) menunjukkan bahwa baik variabel Pengangguran telah stasioner. Hal tersebut ditunjukkan dari semua model terbaik digunakan dengan kriteria *AIC minimum* semua model memiliki nilai t-statistik lebih kecil atau lebih negatif dari nilai *Mackinnon Critical Value* sebesar 5%. Karena data telah stasioner pada derajat pertama, maka pada pembeda pertama atau *ordo* pertama data tersebut dilakukan analisis untuk menguji hipotesis dalam penelitian melalui uji kausalitas granger.

3. Uji Kausalitas Granger

Berdasarkan hasil penelitian dengan menggunakan uji kausalitas granger menunjukkan adanya hubungan kausalitas satu arah antara inflasi dengan pengangguran di Indonesia. Menurut hasil uji DUNEMP (pengangguran) terhadap INF (inflasi) yang ditunjukkan uji kausalitas

granger, hipotesis nol untuk tingkat DUNEMP (pengangguran) mempengaruhi INF (inflasi). Hasil ini berarti ada pola kausalitas satu arah antara variabel pengangguran dengan inflasi, yaitu pengangguran menyebabkan inflasi.

2. Saran

Berdasarkan kesimpulan dari penelitian ini, maka saran yang diberikan penulis semoga dapat dijadikan pertimbangan bagi proyeksi pembangunan ekonomi di Indonesia untuk masa mendatang dan untuk para pembaca dalam melakukan penelitian selanjutnya adalah sebagai berikut :

- a. Hasil penelitian ini disimpulkan bahwa ada pola hubungan kausalitas satu arah antara inflasi dengan pengangguran di Indonesia. Hal ini ditunjukkan Pemerintah harus lebih peka terhadap pengangguran yang ada di Indonesia sehingga pengangguran yang ada di Indonesia bisa di kurangi dengan cara membuka lapangan pekerjaan.
- b. Bagi para peneliti lain yang ingin meneliti mengenai Inflasi dengan pengangguran di Indonesia , maka agar hasil penelitian tersebut lebih valid maka jumlah observasi harus lebih banyak dan menambah variabel lain yang mempunyai pengaruh yang signifikan terhadap pengangguran.

F. DAFTAR PUSTAKA

- Amir, Amri. 2010. Pengaruh Inflasi dan Pertumbuhan Ekonomi terhadap Pengangguran di Indonesia
- Ariefianto, D.M. 2012, Ekonometrika Esensi dan Aplikasi dengan menggunakan Eviews, PT Gelora Aksara Pratama. Penerbit Erlangga.
- Arsyad, Lincoln. 2010. Ekonomi Pembangunan. Yogyakarta: STIM YKPN Yogyakarta.
- Badan Pusat Statistik. 2014. Statistik Indonesia. www.bps.go.id. Diakses tanggal 1 November 2013
- Case and fair. 2008. "Prinsip-prinsip Ekonomi, Edisi Kedelapan, Jilid Dua, Jakarta: Erlangga.

- Damodar N, Gujarati, 1995. *Dasar-dasar Ekonometrika* .Jakarta: Salemba Empat.
- Dritsaki, Chaidodkk, 2012. “*Inflation, Unemployment and the NAIRU in Greece*”, Brunel University: West London.
- Ismawanto. 2013. <http://ssbelajar.blogspot.com/2013/01/dampak-dan-cara-mengatasi-pengangguran.html>. Diakses 8 juli 2014
- Juanda, Bambang dan Junaidi, 2012, *Ekonometrika Deret Waktu Teori dan Aplikasi*. IPB. PT Penerbit IPB Press.
- Mankiw N,Gregory, dkk, 2012, *Pengantar Ekonomi Makro*. Jakarta: Salemba Empat.
- Mankiw N,Gregory, dkk. 2003. *Teori Makroekonomi*. Jakarta: Erlanga
- Nanga, Muana, 2001. *Teori Makro Ekonomi* ,Edisi Pertama, Jakarta: Rajawali Press.
- Nopirin, Ph.D. 1992, Buku II, Edisi Pertama, *Ekonomi Moneter*, BPFYogyakarta
- Phillips, A, W, 2005, *The Relation between Unemployment and the Rate of Change of Money Wage Rates in the United Kingdom, 1861-1957*, *Economica*, New Series, Vol. 25, No. 100 (Nov., 1958), 283-299.
- Qianyi, Wang, 2013, *The Research on Inflation Rate in CHINA*. Jurnal Proceeding of the International Conference on Social Science Research, ICSR University of Malaya: e-ISBN 978-976-11768-1-8.
- Rizki, Perdana K. 2012. Analisis kausalitas Pertumbuhan Ekonomi, tingkat inflasi, dan Pengangguran Studi Kasus Kota-Kabupaten se-Jawa Timur, Universitas Brawajaya: Malang.
- Samuelson, Paul A dan Nordhaus, William D,2001, *Ilmi Makro Ekonomi*.Jakarta PT. Media Edukasi.
- Samuelson, Paul A dan Nordhaus, William D,2004, *Ilmi Makro Ekonomi*.Jakarta PT. Media Edukasi.
- Setyowati, Eny, 2003, *Uji kausalitas Granger: Inflasi dan Pengangguran di Indonesia*, Universitas Muhammadiyah: Surakarta.

- Sukarsih, dkk, 2011, *Studi Empiris Kurva Phillips New Keynesian di Indonesia*, Universitas Jendral Sudirman.
- Sukirno, Sadono. 2002. *Pengantar Teori Makroekonomi*. Jakarta: PT RajaGrafindo Persada.
- Sukirno, Sadono. 2004. *Pengantar Teori Makroekonomi*. Jakarta: PT Raja Grafindo Persada.
- Sukirno, Sadono. 2007. *Makro ekonomi Modern*. Jakarta: PT Raja Grafindo Persada.
- Sukirno, Sadono. 2008. *Teori Pengantar Makroekonomi edisi 3*. PT.Raja grafindo persada. Jakarta
- Todaro, Michael P, 1998: *Pembangunan Ekonomi Dunia ketiga*, Jakarta: Erlangga.
- Todaro,Michael P, 2013. edisi kesebelas. *Pembangunan Ekonomi*. Erlangga. Jakarta.
- Utomo, Fajar Wahyu, 2013, *Pengaruh Inflasi dan Upah terhadap Pengangguran di Indonesia Periode Tahun 1980-2010*, Universitas Brawajiya: Malang.
- Utomo, Prihadi Yuni. 2012. *Eviews: Buku Praktik Komputer Statistik II*. Surakarta: Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Muhammadiyah Surakarta.