

Dampak Ketidakpastian Nilai Tukar Indonesia terhadap pertumbuhan ekspor periode 1979.1-1998.4: Suatu pendekatan teknik kointegrasi dan model koreksi kesalahan

Antonius Eko Susilo Riadi, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=109615&lokasi=lokal>

Abstrak

Tesis ini meneliti mengenai dampak ketidakpastian nilai tukar efektif riil Indonesia terhadap pertumbuhan ekspor non migas riil menggunakan periode waktu 1979.1-1998.4. Hipotesa yang diuji adalah apakah ketidakpastian nilai tukar efektif riil mempunyai dampak negatif terhadap ekspor non migas riil baik dalam jangka pendek maupun dalam jangka panjang. Untuk menguji hipotesa tersebut digunakan fungsi permintaan ekspor non migas riil sebagai fungsi dari pendapatan luar negeri, harga relatif, indeks nilai tukar tertimbang ekspor non migas dan ketidakpastian nilai tukar efektif riil dengan memfokuskan penelitian pada variabel ketidakpastian nilai tukar. Ukuran yang digunakan untuk variabel ketidakpastian ! fluktuasi nilai tukar adalah standar deviasi nilai tukar efektif riil rata-rata bergerak 4 triwulan sebelumnya.

Hasil uji kointegrasi prosedur Johansen menunjukkan adanya kointegrasiiketerkaitan antara variabel ekspor non migas riil dengan pendapatan luar negeri, harga relatif, indeks nilai tukar dan ketidakpastian nilai tukar efektif. Hasil penelitian juga menunjukkan bahwa hanya dalam jangka panjang variabel ketidakpastian nilai tukar efektif riil tersebut memberikan dampak negatif terhadap ekspor non migas riil, sedangkan dalam jangka pendek tidak mempengaruhi ekspor non migas riil.