

# Hubungan ekspor, impor dan Produk Domestik Bruto (PDB) sektor keuangan Perbankan Indonesia periode tahun 2000:Q1-2011:Q4 : suatu pendekatan dengan model analisis Vector Autoregression (VAR) = The relationship of export, import and gross domestic product (GDP) of the financial sector of banking in Indonesia in 2000:Q1 -2011:Q4 period : a vector autoregression (VAR) model analysis approach

Rahman Hakim, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20299931&lokasi=lokal>

---

## Abstrak

Ekspor, Impor dan sektor Keuangan merupakan kegiatan strategis dalam perekonomian terbuka. Penelitian ini mengambil periode transaksi triwulanan berdasarkan Produk Domestik Bruto (PDB) tahun 2000:Q1-2011:Q4. Melalui analisis model Vector Autoregression didapatkan hasil bahwa Data yang digunakan dalam penelitian ini stasioner pada diferensi pertama dan tidak terjadi kointegrasi, Sementara Hasil pengujian hubungan kausalitas Granger menunjukkan adanya hubungan kausalitas antar variabel.

Berdasarkan analisis impulse response function dapat dilihat bahwa shock pada setiap variabel akan menghasilkan guncangan yang sangat tajam di awal periode, namun akan stabil sampai akhir periode. Analisis Variance Decomposition menunjukkan porsi penjelasan masing-masing variabel masih didominasi oleh dirinya sendiri, kecuali variabel Impor yang tetap didominasi oleh Ekspor. Dominasi ekspor dalam mempengaruhi faktor-faktor lain sangat terlihat, baik dalam mempengaruhi impor maupun jasa bank, begitu pula impor yang juga mempunyai hubungan kausalitas terhadap perbankan. Dengan kata lain, produktifitas jasa perbankan dipengaruhi secara positif oleh fluktuasi nilai transaksi ekspor dan impor sehingga peningkatan dan penurunannya dipengaruhi oleh peningkatan dan penurunan transaksi ekspor dan impor.

<hr>

Export, Import and finance sector is a strategic activity in an open economy. This study takes a period of a transaction based on the quarterly Gross Domestic Product (GDP) in 2000:Q1-2011:Q4. Through a Vector Autoregression model analysis showed that data used in this study is stationary at first difference and there is no co-integration found, while Granger causality test results indicate a causal relationship between variables.

Based on the analysis of impulse response function can be seen that the shock on each variable will produce a very sharp shock at the beginning of the period, but will be stable until the end of the period.

Analysis of Variance Decomposition shows the portion of an explanation of each variable is still dominated by themselves, except Import variables which remain dominated by Export. Export dominance in influencing other factors are highly noticeable, both in imports and bank services, as well as imports also have causal relationships to the bank services. In other words, the productivity of banking services is positively influenced by fluctuations in the export and import transactions that increase and decline influenced by the increase and decrease in export and import transactions.