

Dampak ketidakpastian nilai tukar terhadap ekspor dan impor antara Indonesia dan Australia (suatu pendekatan error correction model dan autoregressive distributed lag) = The effect of exchange rate volatility on export and import the application of error correction model and autoregressive distributed lag

Pretty Failasufa Aziza, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20387164&lokasi=lokal>

Abstrak

Penelitian ini meneliti mengenai dampak ketidakpastian nilai tukar terhadap ekspor dan impor antara perdagangan bilateral Indonesia dengan Australia menggunakan periode waktu 2001-2013. Tujuan dari penelitian ini adalah untuk menguji bagaimana hubungan jangka panjang dan jangka pendek antara ketidakpastian nilai tukar dengan pertumbuhan ekspor dan impor. Data yang digunakan adalah data time series ekspor dan impor dari industri total. Untuk menguji hipotesis tersebut digunakan penghitungan Error Correction Model (ECM) dengan beberapa tahapan mulai dari penentuan panjang lag, uji kointegrasi untuk melihat hubungan jangka panjang, dan Autoregressive Distributed Lag (ARDL) untuk melihat hubungan jangka pendek. Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwa ketidakpastian nilai tukar memiliki hubungan terhadap ekspor dan impor baik jangka panjang maupun jangka pendek.

<hr>

This study analyzes the effect of exchange rate volatility on export and import in bilateral trade between Indonesia and Australia using the time period 2001-2013. The objective of this study is to examine the long run and short run between exchange rate volatility on export and import. This study uses time series data from export and import of the total industry. To examine the hypothesis, this study uses error correction model and autoregressive distributed lag. This study find that exchange rate volatility has relationship with export and import in long run and short run.