

Pengaruh ekspor, impor, inflasi dan trade-balance terhadap nilai tukar rupiah di Indonesia: pendekatan granger causality = Impact of export import inflation and trade balance to rupiah's exchange rate in Indonesia: granger causality analysis

Angga Pangeran Noorsaman, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20458735&lokasi=lokal>

Abstrak

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui adanya kausalitas atau hubungan antara Inflasi, Ekspor, Impor, dan Trade-Balance di Indonesia, serta efeknya saat sebelum dan sesudah krisis finansial global 2008. penelitian ini menggunakan metode regresi granger causality selama kurang lebih enam belas tahun yaitu dari Januari 2000 hingga Desember 2015 menggunakan data bulanan. penelitian ini menemukan bahwa inflasi, Ekspor, Impor dan Trade-balance berpengaruh secara signifikan kepada nilai tukar rupiah terhadap dolar Amerika. Dengan nilai koefisien masing-masingnya secara berurutan -20.542 untuk inflasi, -2.396 untuk impor, -1,258 untuk ekspor dan 0.31 untuk neraca perdagangan maka akan mempengaruhi Nilai Tukar Rupiah di Indonesia. penelitian ini juga menemukan adanya hubungan kausalitas yang juga berpengaruh signifikan terhadap nilai tukar rupiah di Indonesia.

.....This study aims to examine that there is causality relationship between inflation, export, import and trade balance in Indonesia, also the impact before and after global financial crisis 2008. this study uses time series data methodology, using annual data for about 16 years from January 2000 until December 2015 using monthly basis data. this result of the study shows that inflation, export, import and trade balance are individually affected exchange re ate of Rupiah. these variables coeffisien value are 20.542 for inflation, 2.396 for import, 1.258 for export and 0.31 for trade balance, so these value wll affects Rupiah 39 s exchange rate. this study also finds that there is a causality relationship, which also significantly takes effect towards exchange rate of rupiah.