ABSTRAK

ULINE AFRIANY PRASETIA SIMARMATA. Analisis Interdependensi Nilai Tukar, Inflasi, Produk Domestik Bruto, Suku Bunga dan Neraca Transaksi Berjalan di Indonesia. Medan : Program Pascasarjana Universitas Negeri Medan 2012.

Depresiasi nilai tukar rupiah mendorong Bank Indonesia menaikkan SBI untuk memperkuat rupiah, inflasi mempunyai trend menurun ketika terjadi apresiasi nilai tukar rupiah, sedangkan pergerakan nilai tukar rupiah merubah posisi neraca transaksi berjalan Indonesia. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui peranan dan efek perubahan nilai tukar, inflasi, produk domestik bruto, suku bunga dan neraca transaksi berjalan terhadap masing-masing variabel. Data diperoleh dari data skunder yaitu data nilai tukar, inflasi, Pendapatan Domestik Bruto, suku bunga dan neraca transaksi berjalan dari tahun 2000:1 sampai dengan tahun 2010:4. Model yang digunakan dalam penelitian ini adalah model ekonometrika dengan metode *Vector Autoregressive* (VAR) yang dalam analisisnya mempunyai instrumen *Impulse Response Function* (IRF) dan *Variance Decomposition* (VD). Hasil penelitian ini menyimpulkan bahwa (1) seluruh variabel saling memberikan kejutan acak terhadap variabel lainnya dan direspon oleh masing-masing variabel sehingga mencapai keseimbangan jangka panjang. Hal tersebut ditunjukkan hasil estimasi uji IRF pada setiap variabel; (2) Semua variabel saling berkontribusi terhadap variabel lainnya. Hal tersebut ditunjukkan oleh hasil estimasi uji VD, dimana setiap variabel memberikan sumbangan terhadap variabel lainnya.

Kata Kunci : Nilai Tukar, Inflasi, Pendapatan Domestik Bruto, Suku Bunga dan Neraca Transaksi Berjalan

THE Character Building UNIVERSITY

ABSTRAC

ULINE AFRIANY PRASETIA SIMARMATA. Interdependence Analysis of Exchange Rate, Inflation, Gross Domestic Product, Interest Rates and the Current Account in Indonesia. Medan : Postgraduate School of State University of Medan 2012.

Depreciation of the rupiah prompted Bank Indonesia raised SBI to strengthen the rupiah, inflation has a downward trend when the appreciation of the rupiah, and the movement of the exchange rate also change the position of the current account of Indonesia. This study aimed to determine the role and effects of changes in exchange rates, inflation, gross domestic product, interest rates and the current account balance for each variable. Data obtained from secondary data is exchange rate, inflation, GDP, interest rates and the current account data from 2000:1 up to 2010:4. The model used in this study is the econometric model by the method of Vector Autoregressive (VAR) that in their analysis the instrument has Impulse Response Function (IRF) and Variance Decomposition (VD). The results of this study concluded that (1) All variable giving each other random shock to other variables and response by each variable so as to achieve long-term equilibrium. This is shown on the estimation IRF test on each variable; (2) All variables are mutually contribute to other variables. It is shown by the results of estimation VD test, in which each variable contributed to other variables.

Keyword : Exchange Rate, Inflation, Gross Domestic Product, Interest Rate and Current Account.

THE Character Building UNIVERSITY