

SUMMARY

ANALISIS POLA HUBUNGAN PERTUMBUHAN EKONOMI INDONESIA DENGAN INDIKATOR EKONOMI PERDAGANGAN INTERNASIONAL MENGGUNAKAN METODE MULTIVARIATE TIME SERIES

ANALYSIS OF THE RELATIONSHIP BETWEEN
INDONESIAN ECONOMIC GROWTH AND FOREIGN
TRADE USING MULTIVARIATE TIME SERIES METHOD

Created by Septimasari, Irma

Subject : Analisis multivarian

Keyword : Multivariate time series ; VARIMA ; pertumbuhan ekonomi ; perdagangan internasional.

Description :

Multivariate time series merupakan salah satu metode time series yang menganalisis lebih dari satu variabel yang dipengaruhi oleh waktu dimana salah satu atau lebih dari variabel-variabel tersebut mempengaruhi variabel yang lain atau dapat juga variabel-variabel tersebut saling mempengaruhi. Dalam penelitian ini, pertumbuhan ekonomi dan perdagangan internasional dipandang sebagai variabel yang saling mempengaruhi sehingga metode multivariate time series yang sesuai untuk menganalisis pertumbuhan ekonomi dan perdagangan internasional adalah metode Vector Autoregressive Integrated Moving Average (VARIMA). Metode VARIMA ini menggunakan Conditional Maximum Likelihood Estimation untuk mengestimasi parameter. Oleh karena metode ini melibatkan banyak parameter, sehingga digunakan prosedur Backward Elimination untuk memperoleh model yang parsimoni. Hasil empiris menunjukkan bahwa pola hubungan pertumbuhan ekonomi Indonesia dengan perdagangan internasional untuk komponen ekspor, adalah saling mempengaruhi, tetapi untuk komponen impor ditemukan pola hubungan yang tidak signifikan dengan pertumbuhan ekonomi.

Description Alt:

Multivariate time series is one of time series methods which analyse several variables caused by time, where one or more variables cause the other variables or there are interdependencies among several variables. This paper consider both Indonesian economic growth and foreign trade as interdependencies variables so that Vector Autoregressive Integrated Moving Average (VARIMA) method optimally can be applied. Conditional Maximum Likelihood Estimation is used to obtain parameter estimation. Caused this method including numerous parameters, so that Backward Elimination is

consequently applied. The result indicate that there is bidirectional caution relationship between Indonesian economic growth and export, but import cause Indonesian economic growth not significantly.

Contributor : Drs. Kresnayana Yahya, M.Sc.
 Dr. Suhartono, S.Si, M.Sc.
Date Create : 10/07/2009
Type : Text
Format : pdf.
Language : Indonesian
Identifier : ITS-Undergraduate-3100008033010
Collection : 3100008033010
Call Number : RSSSt 519.535 Sep a
Source : Undergraduate theses of Statistic, RSSSt 519.535 Sep a, 2008
COverage : ITS Community Only
Right : Copyright @2008 by ITS Library. This publication is protected by copyright and permission should be obtained from the ITS Library prior to any prohibited reproduction, storage in a retrieval system, or transmission in any form or by any means, electronic, mechanical, photocopying, recording, or likewise. For information regarding permission(s), write to ITS Library

Full file - Member Only

If You want to view FullText...Please Register as MEMBER

Contact Person :

Mr. Edy Suprayitno (edy_supra@its.ac.id)

Mrs. Ansi M. Putri(ansi@its.ac.id)

Mr. Taufik Rachmanu (taujack@its.ac.id)

Mrs. Dewi Eka Agustina (dee@its.ac.id)

Thank You,

Nur Hasan

ITS Digilib Supervisor