

UNIVERSITAS BINA NUSANTARA

Program Ganda
Teknik Informatika - Statistika
Skripsi Sarjana Program Ganda
Semester Ganjil 2009/2010

APLIKASI GRANGER CAUSALITY BERBASIS KOMPUTER PADA PERUBAHAN NILAI TUKAR EURO, US DOLLAR TERHADAP RUPIAH

Fransiscus Denny
0900793483

ABSTRACT

Recent crisis which occurred across a variety of different assets and markets at the global level shows that the importance of causality influence among the international market. With so many economic variables that can be used as the parameters in taking decision in the trading, causing difficulty to the investor to determine the correct economic variables. One approach that can be used to solve these problems is to perform Granger causality test. In this thesis, the test will be applied to the exchange rate of Euro (€) and U.S. dollar (\$) against the Indonesian rupiah (Rp) in a Vector Autoregressive (VAR) framework to examine the possible relationship among the three currencies.

Keyword : currency, Granger causality test, Vector Autoregressive.

ABSTRAK

Krisis yang belakangan ini terjadi melintasi berbagai aset yang berbeda dan pasar di tingkat global menunjukkan bahwa pentingnya pengaruh kausalitas diantara pasar internasional. Dengan banyaknya variabel-variabel ekonomi yang dapat dijadikan sebagai parameter dalam melakukan pengambilan keputusan di dalam perdagangan, menyebabkan para investor mengalami kesulitan untuk menentukan variabel-variabel ekonomi yang tepat. Salah satu pendekatan yang dapat digunakan untuk menyelesaikan permasalahan tersebut adalah dengan melakukan uji kausalitas Granger. Dalam skripsi ini, pengujian akan diaplikasikan pada nilai tukar Euro (€) dan US dollar (\$) terhadap Indonesian rupiah (Rp) di dalam kerangka kerja Vector Autoregressive (VAR) untuk mengamati hubungan yang mungkin terjadi diantara ketiga mata uang yang diteliti.

Kata Kunci : mata uang, uji kausalitas Granger, Vector Autoregressive.