

Abstrak

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis hubungan kausalitas antara *Total Factor Productivity* (TFP) dengan ekspor industri manufaktur Indonesia selama periode 1978-2007. Penelitian ini menggunakan tiga pendekatan ekonometrika, yaitu *Ordinary Least Square* (OLS), uji kausalitas Granger, dan *Vector Autoregression* (VAR). Pendekatan OLS diterapkan untuk mengestimasi nilai TFP industri manufaktur selama periode penelitian. Langkah selanjutnya, adalah pengujian kausalitas Granger untuk melihat arah kausalitas TFP dan ekspor. Pendekatan VAR digunakan untuk melihat pengaruh perubahan dari ekspor terhadap TFP, begitu pula sebaliknya. Hasil estimasinya menunjukkan adanya hubungan kausalitas satu arah dari ekspor ke TFP. Hasil uji kausalitas ini juga didukung hasil *Impulse Respon Function* (IRF) dan *Variance Decomposition*. Hasil IRF menunjukkan bahwa dalam jangka pendek *shock* variabel ekspor berpengaruh pada perubahan keseimbangan TFP, namun dalam jangka panjang TFP bergerak ke arah ekuilibrium awal. Hasil *Variance Decomposition* juga menjelaskan bahwa kontribusi ekspor terhadap TFP mengalami peningkatan tiap tahun.

Kata kunci: *Total Factor Productivity* (TFP), ekspor, *Ordinary Least Square* (OLS), uji kausalitas Granger, *Vector Autoregression* (VAR), industri manufaktur Indonesia



Abstract

This paper aims to analyze causal relationship between Total Factor Productivity (TFP) and export in Indonesia's manufacturing industry over the period 1978-2007. This paper uses three econometrics approaches, there are Ordinary Least Square (OLS), Granger Causality Test, and Vector Autoregression (VAR). OLS is used to estimate TFP value. Then, Granger Causality Test is used for analyzing causal relationship between Total Factor Productivity (TFP) and export. Finally, VAR method is used to see export shock effect on TFP, and vice versa. The result shows that there is unidirectional causality from ekspor to total factor productivity (TFP). This result is supported by Impulse Response and Variance Decomposition results. Impulse Response shows that export shock, in the short run affects TFP value, but in long run the equilibrium of TFP will be return to the initial condition. The result of variance decomposition also shows that the contribution of export to TFP is increasing in each year.

Keywords : *Total Factor Productivity (TFP), export, Ordinary Least Square (OLS), Granger Causality Test, Vector Autoregression (VAR), Indonesian manufacturing industry*

