

ABSTRAK

Penelitian ini merupakan penelitian kuantitatif. Data yang digunakan dalam penelitian ini adalah PDB, Ekspor, dan Impor, atas dasar harga konstan tahun 2000. Tujuan penelitian ini adalah untuk mengetahui ada tidaknya hubungan kausalitas serta antara ekspor dan impor dengan Produk Domestik Bruto (PDB) di Indonesia dengan memakai data sekunder *time series* tahun 2008.I-2018.III. Penelitian ini menerapkan metode *Vector Autoregression* (VAR) yang meliputi uji *impulse response* (IRF), analisis *Variance Decomposition* (VD), dan *Granger-Causality test*. Berdasarkan uji *impulse response*, respon yang dihasilkan oleh PDB atas *shock* yang terjadi pada impor dan ekspor berpotensi tidak permanen. Begitu juga respon ekspor dan respon impor atas *shock* yang diberikan PDB juga berpotensi tidak permanen. Analisis *Variance Decomposition* menunjukkan PDB dan impor awalnya di dominasi oleh dirinya sendiri dan periode selanjutnya cenderung menurun, sedangkan ekspor selalu di dominasi oleh PDB dan impor. Hasil uji *Granger-Causality test* menunjukkan antara ekspor dan impor dengan PDB tidak terdapat kausalitas dua arah, namun terdapat dua hubungan satu arah (*unidirectional*), yang meliputi PDB ke ekspor dan PDB ke impor.

Kata kunci : PDB, Ekspor, Impor, VAR, IRF, VD, Granger-Causality.