

DEPARTEMEN PENDIDIKAN NASIONAL  
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS UNIVERSITAS AIRLANGGA

Program Studi : Ekonomi Pembangunan  
Daftar No. : .....

**ABSTRAK**  
**SKRIPSI SARJANA EKONOMI**

Nama : Raab Hasanah Aries Oktaviana  
N.I.M. : 040710512  
Tahun Penyusunan : 2015

JUDUL:

Volatilitas Nilai Tukar Dan Pertumbuhan Ekonomi Studi Kasus Indonesia

ISI:

Keterbukaan perdagangan merupakan cara dalam meningkatkan perdagangan internasional antar negara yang menyebabkan adanya hubungan antara nilai tukar, ekspor-impor, dan investasi. Penelitian ini bertujuan meneliti adanya volatilitas pada nilai tukar riil dengan menggunakan metode ARCH (*Autoregressive Conditional Heteroscedasticity*). Selain itu juga melihat pengaruh volatilitas nilai tukar riil, ekspor neto, investasi, dan *trade openness* terhadap pertumbuhan ekonomi Indonesia.

Penelitian ini menggunakan *Vector Error Correction Model* (VECM) untuk mengetahui hubungan jangka panjang antara volatilitas nilai tukar riil, ekspor neto, investasi, dan *trade openness* terhadap pertumbuhan ekonomi Indonesia. Berdasarkan hasil uji ARCH, terdapat volatilitas pada nilai tukar riil. Hasil estimasi VECM, volatilitas nilai tukar riil, ekspor neto, investasi, dan *trade openness*, secara signifikan berpengaruh terhadap pertumbuhan ekonomi Indonesia dalam jangka panjang.

Kata Kunci: Volatilitas nilai tukar, pertumbuhan ekonomi, ARCH, VECM

SUBJEK/OBJEK PENELITIAN : Nilai tukar dan Pertumbuhan Ekonomi

DAERAH PENELITIAN : Indonesia